ALLIANCEBERNSTEIN®

JAHRESBERICHT

AB SICAV 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 Jahresbericht entfernt. Die Anleger werden auf die Tatsache hingewiesen, dass bestimmte Zahlen in diesem verkürzten Jahresbericht auf konsolidierter Basis dargestellt sind und daher die Zahlen der Portefeuilles umfassen, die nicht zum Angebot an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz registriert sind.

Equity

+ International Health Care Portfolio
+ International Technology Portfolio
+ Global Real Estate Securities Portfolio
+ Sustainable Global Thematic Portfolio
+ India Growth Portfolio
+ US Small and Mid-Cap Portfolio
+ Select US Equity Portfolio
+ Low Volatility Equity Portfolio
+ Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio
+ Global Equity Income Portfolio
+ Concentrated US Equity Portfolio
+ Concentrated Global Equity Portfolio
+ Global Core Equity Portfolio
+ European Equity Portfolio
+ Eurozone Equity Portfolio
+ American Growth Portfolio
+ China A Shares Equity Portfolio

Fixed Income

+ Euro High Yield Portfolio
+ RMB Income Plus Portfolio
+ Short Duration High Yield Portfolio
+ Global Plus Fixed Income Portfolio
+ Emerging Market Local Currency Debt Portfolio
+ Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio
+ Emerging Market Corporate Debt Portfolio
+ US High Yield Portfolio
+ Global Dynamic Bond Portfolio
+ Global Income Portfolio
+ Financial Credit Portfolio
+ Sustainable Global Thematic Credit Portfolio

Multi-Asset/Asset Allocation

+ Emerging Markets Multi-Asset Portfolio
+ All Market Income Portfolio

Alternatives

+ Select Absolute Alpha Portfolio
+ Alternative Risk Premia Portfolio

AB SICAV I ist eine Investmentgesellschaft mit variablem Kapital *(société d'investissement à capital variable)*, die mit beschränkter Haftung gemäß den Gesetzen des Großherzogtums Luxemburg gegründet wurde.

RCS: B117 021

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.

Hongkong

Mit Stand vom 31. Mai 2020 sind folgende Portefeuilles des Fonds in Hongkong nicht zugelassen und können den Einwohnern von Hongkong nicht angeboten werden: Select Absolute Alpha Portfolio, Global Income Portfolio, Alternative Risk Premia Portfolio, China A Shares Equity Portfolio, Financial Credit Portfolio und Sustainable Global Thematic Credit Portfolio.

Im Zeitraum vom 1. Juni 2019 bis zum 9. Dezember 2019 (Schließungsdatum) war das Global Equity Income Portfolio in Hongkong nicht zugelassen und konnte den Einwohnern von Hongkong nicht angeboten werden.

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.

Verwaltungsratsmitglieder des Fonds

Vorsitzender

Silvio Cruz – Mitglied des Verwaltungsrats seit Januar 2012

Silvio Cruz ist Senior Vice President und Managing Director im Bereich Global Product Strategy & Development bei AllianceBernstein. Daneben ist Silvio Cruz Managing Director von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. Seit 1996 sammelte Silvio Cruz Erfahrungen in Bereichen wie der Betreuung grenzüberschreitender Vertriebskanäle für Privatkunden, institutionelle Kunden und Privatkunden, Fondsstrukturierung, Fondsauflegungen, Fondsführung, Geschäftsstrategie und -aufsicht, Produktstrategie und -entwicklung, Fondsbuchhaltung, Fondsverwaltung, Depot- und Transferstellentätigkeiten zur Unterstützung der anlageverwaltungs- und fondsbezogenen Aktivitäten von AB in Luxemburg, dem Vereinigten Königreich, Irland, Japan, Hongkong, Taiwan, den USA und den Kaimaninseln. Zuvor war Silvio Cruz als Wirtschaftsprüfer für Anlagefonds bei der New York Life Insurance Company tätig. Silvio Cruz besitzt einen BS in Accounting von der Rutgers University und einen MBA mit Schwerpunkt Finanzwesen von der Rutgers Business School. Silvio Cruz ist bei der FINRA als General Securities Representative eingetragen und besitzt eine Lizenz der Serie 7 und 63 für den Bundesstaat New York. Darüber hinaus ist er Chartered Alternative Investment Analyst (CAIA).

Verwaltungsratsmitglieder

Bertrand Reimmel – Mitglied des Verwaltungsrats seit August 2012

Bertrand Reimmel, Senior Vice President, kam im August 2005 als Leiter der Abteilung Legal & Compliance zu AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. und ist seit 2012 auch Managing Director von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. Als Managing Director leitet Bertrand Reimmel die Geschäftsbereiche Legal & Compliance, AML, Risiko und Corporate Accounting sowie die Niederlassungen von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. und die Tochtergesellschaften. Bertrand Reimmel ist seit 1998 Mitglied der Luxemburger Anwaltskammer. Vor seinem Eintritt bei AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. arbeitete er mehr als acht Jahre bei Elvinger Hoss Prussen, eine der führenden luxemburgischen Anwaltskanzleien, wo er sich bereits mit AllianceBernstein beschäftigte. Bertrand Reimmel spielte auch eine wichtige Rolle bei der Auflegung und Umstrukturierung der europäischen OGAW und AIF von AllianceBernstein. Des Weiteren ist Bertrand Reimmel aktives Mitglied verschiedener ALFI-Arbeitsgruppen. Seine 20-jährige Erfahrung in der luxemburgischen und europäischen Fondsindustrie und sein bedeutendes technisches Fachwissen zu OGAW und alternativen Investmentfonds machen ihn zu einem der ranghöchsten Anwälte der AllianceBernstein International Legal Group.

Scott Parkin – Mitglied des Verwaltungsrats seit Juli 2019

Scott Parkin kam im Jahr 2017 als Vice President und Rechtsberater, Director of International Legal zu AllianceBernstein L.P. Scott Parkin ist als leitender Anwalt für Rechtsfragen im Zusammenhang mit dem internationalen Vermögensverwaltungsgeschäft der Firma, insbesondere den internationalen Fondsplattformen, zuständig. Vor seinem Eintritt bei AllianceBernstein L.P. war er als Senior Legal Counsel bei HSBC Global Asset Management (USA) Inc für ähnliche Rechtsangelegenheiten zuständig. Er besitzt einen BA der Colgate University aus dem Jahr 2007 und einen JD von der Western New England School of Law aus dem Jahr 2010.

Olivia Moessner – Mitglied des Verwaltungsrats seit Oktober 2019

Frau Moessner ist Partnerin der Anwaltskanzlei Elvinger Hoss Prussen, *société anonyme*. Die Berufserfahrung von Olivia Moessner konzentriert sich auf kollektive Vermögensverwaltung und Investmentfonds. Olivia Moessner berät eine Reihe von Investmentfonds-Anbietern und anderen Finanzinstitutionen in Bezug auf den Aufbau und die Strukturierung ihrer luxemburgischen Investmentfondsgeschäfte. Ihre Erfahrungen umfassen ein breites Spektrum von Investmentfonds (OGAW, OGA, SIF und RAIF) und die Umsetzung verschiedener Anlagestrategien, einschließlich Hedge-Fonds-Strategien.

Olivia Moessner ist seit dem Jahr 2001 Mitglied der Luxemburger Anwaltskammer und Mitglied zahlreicher Arbeitsgruppen der ALFI (Association of the Luxembourg Fund Industry) zu verschiedenen europäischen Schlüsselthemen wie OGAW-konforme Vermögenswerte, SFTR, ETFs, MIFID, PRIIPs, ELTIFs, Geldmarktfonds und Pensionsfonds.

Susanne van Dootingh – Mitglied des Verwaltungsrats seit Januar 2020

Susanne van Dootingh ist unabhängiges Verwaltungsratsmitglied verschiedener in Luxemburg ansässiger Anlagefonds und Anlageverwaltungsgesellschaften. Vor ihrer Ernennung zum unabhängigen Verwaltungsratsmitglied war sie von 2002 bis 2017 bei State Street Global Advisors beschäftigt, zuletzt als Senior Managing Director, Head of European Governance and Regulatory Strategy EMEA. Davor hatte sie verschiedene leitende Positionen bei State Street Global Advisors im Bereich Global Product and Fixed Income Product Engineering inne. Vor ihrem Eintritt bei SSGA im Jahr 2002 war sie bei Fortis Investment Management, Barclays Global Investors und ABN AMRO Asset Management beschäftigt. Sie besitzt einen Master of Arts in Finanzsektor-Management der Vrije Universiteit Amsterdam.

Struktur des Fonds

AB SICAV I (der „Fonds“) ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital (société d'investissement à capital variable), die mit beschränkter Haftung gemäß der Rechtsprechung des Großherzogtums Luxemburg am 8. Juni 2006 gegründet wurde und gemäß Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen zur gemeinsamen Anlage in übertragbare Wertpapiere (in der jeweils gültigen Fassung) (das „Gesetz von 2010“) eingetragen wurde. Der Fonds erfüllt die Voraussetzungen eines Organismus zur gemeinsamen Anlage in übertragbare Wertpapiere („OGAW“) im Sinne der Bedeutung von Artikel 1(2) der EG-Direktive 2009/65 vom 13. Juli 2009 (in der jeweils gültigen Fassung).

Der Fonds wird als Umbrella-Fonds mit separaten Anlagenpools (jeweils ein „Portefeuille“) verwaltet. Zum 31. Mai 2020 hatte der Fonds 44 Portefeuilles.

Der Fonds bietet verschiedene Anteilklassen in jedem seiner Portefeuilles an. Alle Anteile derselben Klasse haben dieselben Rechte bezüglich Ausschüttungen und Rücknahmen.

Mehrere Portefeuilles und Anteilklassen des Fonds sind für den Vertrieb in den folgenden Ländern registriert: Österreich, Bahrain, Belgien, Chile, Kroatien, Tschechische Republik, Dänemark, Finnland, Frankreich, Deutschland, Hongkong, Ungarn, Island, Israel, Italien, Japan, Südkorea, Macau, Niederlande, Norwegen, Polen, Portugal, Rumänien, Singapur, Slowakei, Spanien, Schweden, Schweiz, Taiwan, Vereinigte Arabische Emirate und Vereinigtes Königreich.

Rolle und Verantwortung des Verwaltungsrats

a. Allgemeine Informationen

Im Berichtsjahr wurden die folgenden Personen zu Verwaltungsratsmitgliedern des Fonds ernannt:

Geschäftsführendes VerwaltungsratsmitgliedNicht-geschäftsführendes VerwaltungsratsmitgliedVorsitzenderGeschäftsführendes VerwaltungsratsmitgliedGeschäftsführendes VerwaltungsratsmitgliedGeschäftsführendes VerwaltungsratsmitgliedUnabhängiges VerwaltungsratsmitgliedNicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied

* *Zu Beginn des Berichtszeitraums war Louis Mangan Verwaltungsratsmitglied. Er schied am 28. Juni 2019 aus.*

** *Zu Beginn des Berichtszeitraums war Yves Prussen Verwaltungsratsmitglied. Er schied am 13. Januar 2020 aus.*

*** *Herr Parkin wurde am 26. Juli 2019 zum Verwaltungsratsmitglied ernannt, Frau Moessner am 31. Oktober 2019 und Frau van Dootingh am 14. Januar 2020.*

Die Verantwortlichkeiten des Verwaltungsrats des Fonds (der „Verwaltungsrat“) unterliegen ausschließlich luxemburgischem Recht. Der Verwaltungsrat ist für die allgemeine Verwaltung und Überwachung des Fonds in Übereinstimmung mit der Satzung des Fonds verantwortlich.

Der Verwaltungsrat ist darüber hinaus für die Umsetzung der Anlageziele und der Anlagepolitik der einzelnen Portefeuilles sowie für die Aufsicht über die Verwaltung und den Betrieb der einzelnen Portefeuilles verantwortlich.

b. Verwahrstelle

Der Verwaltungsrat hat Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. (die „Verwahrstelle“) zur Verwahrstelle des Fonds für die folgenden Aufgaben ernannt: (i) die Verwahrung der Vermögenswerte des Fonds, (ii) die Barmittelüberwachung, (iii) die Wahrnehmung von Aufsichtsfunktionen und (iv) die Erbringung anderer, von Zeit zu Zeit vereinbarter und im Verwahrstellenvertrag angegebener Dienstleistungen.

Die Verwahrstelle ist ein in Luxemburg gegründetes Kreditinstitut mit eingetragenem Sitz in 80, Route d'Esch, L-1470 Luxemburg, das im Luxemburger Handels- und Gesellschaftsregister unter der Nummer B 29923 eingetragen ist. Sie ist befugt, Bankgeschäfte gemäß den Bestimmungen des Luxemburger Gesetzes vom 5. April 1993 über den Finanzdienstleistungssektor (in der jeweils geltenden Fassung) auszuführen.

b. Übertragene Funktionen

Verwaltungsgesellschaft

Der Verwaltungsrat hat AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. zur Verwaltungsgesellschaft des Fonds ernannt. Diese ist unter Aufsicht des Verwaltungsrates für die tägliche Bereitstellung von Administrations-, Marketing-, Anlageverwaltungs- und Beratungsdienstleistungen in Bezug auf sämtliche Portefeuilles verantwortlich.

Die Verwaltungsgesellschaft ist (i) eine gemäß Kapitel 15 des Gesetzes von 2010 zugelassene Verwaltungsgesellschaft und (ii) ein gemäß Kapitel 2 des Gesetzes vom 12. Juli 2013 über Verwalter alternativer Investmentfonds zugelassener Verwalter alternativer Investmentfonds in Luxemburg.AllianceBernstein Investor Services, ein Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft, fungiert als Register- und Transferstelle des Fonds. Die Transferstelle ist für die Bearbeitung von Käufen, Rücknahmen, Umwandlungen und Übertragungen der Fondsanteile verantwortlich.

Anlageverwalter

Die Verwaltungsgesellschaft hat ihre Anlageverwaltungs- und Beratungsaufgaben für sämtliche Portefeuilles gemäß den Bedin-

gungen eines Anlageverwaltungsvertrags an AllianceBernstein L.P., eine in Delaware errichtete Limited Partnership mit Hauptsitz in 1345 Avenue of the Americas, New York, New York 10105, USA, übertragen. Es handelt sich um einen führenden globalen Anlageverwalter, der über eine breite Palette von Anlagen diversifizierte Dienstleistungen für Institutionen und Privatpersonen anbietet.

Verwaltungsstelle

Die Verwaltungsgesellschaft hat die Verwaltungsaufgaben des Fonds gemäß den Bedingungen des Verwaltungsstellenvertrags an Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. übertragen. Die Verwaltungsstelle ist für die durch das luxemburgische Gesetz vorgeschriebenen allgemeinen Verwaltungsfunktionen verantwortlich, z. B. die Berechnung des Nettoinventarwerts der Anteile und die Buchführung. Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A. fungiert auch als Zahlstelle des Fonds.

Verwaltungsratssitzungen

Während des Geschäftsjahres des Fonds fanden zwei Verwaltungsratssitzungen statt. Der Verwaltungsrat tritt im Allgemeinen vierteljährlich im Januar, April, Juli und Oktober zusammen. Bei Bedarf werden jedoch *Ad-hoc*-Sitzungen vereinbart. Während des Geschäftsjahres des Fonds wurde keine *Ad-hoc*-Verwaltungsratssitzung einberufen.

Ereignisse während des Geschäftsjahres

- Am 7. November 2019 beschloss der Verwaltungsrat, das AB SICAV I – Global Equity Income Portfolio mit Wirkung zum 9. Dezember 2019 aufzulösen. Der Kassenbestand des AB SICAV I – Global Equity Income Portfolio belief sich zum 31. Mai 2020 auf 32.164 USD.
- Die Anteilinhaber von AllianceBernstein China Investments haben die Zusammenlegung des AllianceBernstein China Investments – China A Shares Value Equity Portfolio (USD), des einzigen Portefeuilles von AllianceBernstein China Investments, bei dem es sich um einen gemäß der geltenden Fassung des Gesetzes vom 13. Februar 2007 gegründeten spezialisierten Investmentfonds handelt, mit dem AB SICAV I – China A Shares Equity Portfolio mit Wirkung zum 6. Dezember 2019 mit einem Zusammenlegungsverhältnis von 1:1 genehmigt. Sämtliche der Klasse SP1 des AllianceBernstein China Investments – China A Shares Value Equity Portfolio (USD) zurechenbaren Vermögenswerte und Verbindlichkeiten wurden der entsprechenden Klasse SP1 im Portefeuille des AB SICAV I – China A Shares Equity Portfolio zugerechnet.

COVID 19

Ab Ende 2019 und bis ins Jahr 2020 weitete sich der Ausbruch des neuen Coronavirus, das eine als COVID-19 bekannte Krankheit verursacht, zu einer globalen Pandemie aus. Wachsende Turbulenzen durch die Ausbreitung dieses Coronavirus und das Potenzial für eine anhaltende und erhebliche negative Auswirkung auf die Weltwirtschaft haben zu einem scharfen Anstieg der Volatilität in allen Märkten und eine starke Flucht in die Qualität ausgelöst.

Der Verwaltungsrat erwartet (und hat bereits beobachtet), dass sich aus den schwierigen Marktbedingungen Probleme ergeben, die für den Fonds und seine Dienstleister zu operativen Schwierigkeiten führen können. Der Verwaltungsrat ist jedoch zuversichtlich, dass die operativen Pläne des Fonds und seiner Dienstleister sowohl im Hinblick auf die gegenwärtigen Umstände als auch bei einer möglichen Verschlechterung der Umstände angemessen sind.

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.

22. Juni 2020

Sehr geehrte Anteilinhaber,

der vorliegende Bericht bietet Ihnen eine aktuelle Übersicht über AB SICAV I (der „Fonds“) für den Jahresberichtszeitraum zum 31. Mai 2020.

Die US-Aktien erzielten im zwölfmonatigen Berichtszeitraum zum 31. Mai 2020 hohe Gewinne, während internationale und Schwellenmarktaktien leichte Verluste verzeichneten. Die Aktienmärkte aller Industrie- und Schwellenländer legten im April und Mai deutlich zu und erholten sich damit von den Tiefs im März, nachdem die zuvor erlittenen drastischen Verluste vor dem Hintergrund der COVID-19-Pandemie die vorherigen Gewinne zunichte gemacht hatten.

Die anhaltende Unterstützung durch die Zentralbanken, die beginnende Wiedereröffnung der Weltwirtschaft und die Aussicht auf einen möglichen Impfstoff trugen dazu bei, trotz eines starken Rückgangs des Wirtschaftswachstums und der wieder aufflammenden Spannungen zwischen den USA und China die Anlegerstimmung zu heben. Am Ende des Berichtszeitraums wiesen Small-Cap-Aktien eine kurzfristige Outperformance gegenüber Large-Cap-Titeln auf. Während des größten Teils des Berichtszeitraums übertrafen die Wachstumswerte die Substanzwerte; gegen Ende des Berichtszeitraums verzeichneten die Substanzwerte jedoch einen deutlichen Wiederanstieg und übertrafen die Wachstumswerte.

Die globalen Rentenmärkte entwickelten sich im zwölfmonatigen Berichtszeitraum unterschiedlich. Die Anlegerstimmung war lebhaft, bis die Ausbreitung von COVID-19 im März eine Panik unter den Anlegern in Risikoanlagen auslöste, die mehrere Wochen anhielt. Die US-Notenbank und andere Zentralbanken in den Industrie- und Schwellenländern leiteten erhebliche Zinssenkungen und Liquiditätsmaßnahmen ein, während die Regierungen rasche und beispiellose finanzpolitische Konjunkturmaßnahmen ergriffen, um die unmittelbaren globalen wirtschaftlichen Auswirkungen des Virus auszugleichen.

Die Staatsanleihen und Investment-Grade-Unternehmensanleihen der Industrieländer erbrachten stabile Renditen. Da sich die Märkte erholten, beendeten hochverzinsliche Unternehmensanleihen und Staatsanleihen aus Schwellenländern den Berichtszeitraum mit positiven, wenn auch gedämpften Gewinnen. Der US-Dollar legte gegenüber den Währungen der meisten Industrie- und Schwellenländer zu. Der Schweizer Franken und der Yen, die ebenfalls als Fluchtwährungen gelten, stiegen gegenüber dem US-Dollar an.

Wir danken Ihnen für Ihre Anlage in den Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

AllianceBernstein L.P., der Anlageverwalter des Fonds

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
International Health Care Portfolio				
Klasse				
A	7.33%	23.06%	4.30%	556.04%
A EUR H	5.75%	19.25%	–	12.73%
AD	7.40%	23.02%	–	14.74%
AX	7.60%	23.68%	4.83%	4548.30%
B	6.81%	21.84%	3.27%	412.39%
BX	7.60%	23.68%	4.82%	712.90%
C	7.10%	22.51%	3.84%	154.33%
ED	6.96%	21.71%	3.50%	26.41%
I	7.76%	24.05%	5.14%	315.73%
I GBP	12.90%	17.27%(1)	–	17.27%
S1	7.96%	24.44%	5.45%	63.37%
S14 GBP	14.67%(2)	–	–	14.67%
International Technology Portfolio				
Klasse				
A	17.38%	35.36%	3.08%	650.36%
A PLN H	15.65%	32.46%	–	24.17%
B	16.79%	34.02%	2.06%	485.97%
C	17.12%	34.77%	2.61%	70.32%
E	16.78%	33.97%	–	31.73%
I	17.84%	36.45%	3.91%	5827.20%
S1	18.08%	36.99%	4.38%	165.91%
Global Real Estate Securities Portfolio				
Klasse				
A	-21.58%	-15.15%	5.99%	150.80%
AD	-21.59%	-15.19%	5.98%	8.66%
AD AUD H	-25.49%	-19.89%	4.84%	6.26%
AD NZD H	-24.32%	-18.47%	4.95%	10.94%
AD SGD H	-22.78%	-16.73%	5.09%	4.45%
B	-21.99%	-16.04%	4.95%	98.44%
BD	-21.98%	-16.03%	4.95%	1.62%
BD AUD H	-25.84%	-20.69%	3.90%	-0.10%
C	-21.79%	-15.57%	5.55%	14.60%
I	-21.27%	-14.50%	6.88%	202.05%
ID	-21.26%	-14.46%	6.87%	1.67%
S1	-21.10%	-14.12%	7.35%	34.60%
Sustainable Global Thematic Portfolio				
Klasse				
A	5.04%	16.30%	-0.20%	191.90%
A AUD H	1.62%	11.70%	-1.54%	133.53%
A EUR H	3.36%	12.80%	-3.26%	53.93%
A SGD H	3.98%	14.70%	-1.32%	55.00%
AN	5.07%	16.31%	-0.16%	100.89%
AX	5.06%	16.32%	-0.19%	436.89%
AXX	5.31%	16.91%	0.30%	870.90%
B	4.54%	15.17%	-1.19%	130.10%
B CAD H	2.56%	12.43%	-2.59%	44.07%
BX	4.53%	15.17%	-1.20%	320.85%
BXX	5.32%	16.90%	0.29%	729.80%
C	4.82%	15.81%	-0.64%	91.47%
CX	4.83%	15.81%	-0.65%	66.87%
I	5.48%	17.26%	0.60%	253.90%
I EUR H	3.85%	13.81%	-2.37%	65.40%
IN	5.48%	17.26%	0.60%	118.25%
IX	5.48%	17.26%	0.61%	313.99%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
Sustainable Global Thematic Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S	6.05%	18.54%	1.75%	148.93%
S GBP	11.06%	21.38%	6.97%	122.20%
S1	5.70%	17.76%	1.03%	131.20%
S1X	5.68%	17.74%	1.04%	165.31%
SD	6.05%	18.57%	1.74%	81.23%
SX	6.05%	18.57%	1.73%	104.86%
India Growth Portfolio				
Klasse				
A	-26.18%	-29.86%	-6.09%	22.51%
A PLN H	-27.06%	-31.18%	–	-32.69%
A SGD H	-26.89%	-30.89%	-6.92%	-15.73%
AD AUD H	-28.59%	-32.79%	-6.75%	-24.84%
AX	-26.09%	-29.70%	-5.88%	997.70%
B	-26.55%	-30.56%	-7.02%	15.66%
BX	-26.47%	-30.42%	-6.82%	745.30%
C	-26.34%	-30.17%	-6.51%	7.39%
I	-25.88%	-29.29%	-5.33%	1618.38%
S	-25.48%	-28.49%	-3.99%	-19.67%
S1	-25.82%	-29.16%	-4.87%	-15.13%
Euro High Yield Portfolio				
Klasse				
A	-6.84%	-2.65%	0.30%	63.62%
A2	-6.88%	-2.65%	0.28%	64.13%
A2 CHF H	-7.00%	-2.97%	-0.18%	9.00%
A2 PLN H	-7.09%	-1.91%	–	-3.12%
A2 USD H	-5.52%	0.11%	3.22%	17.53%
AA	-6.88%	-2.63%	0.28%	12.82%
AA AUD H	-8.87%	-3.95%	2.57%	26.19%
AA HKD H	-5.42%	0.13%	2.35%	18.61%
AA RMB H	-5.46%	0.33%	3.63%	29.60%
AA SGD H	-6.48%	-1.18%	2.36%	19.07%
AA USD H	-5.56%	0.12%	3.27%	23.04%
AR	-6.90%	-2.67%	0.25%	7.45%
AT	-6.93%	-2.69%	0.25%	64.07%
AT AUD H	-8.63%	-3.73%	2.61%	20.43%
AT SGD H	-6.52%	-1.20%	2.35%	19.05%
AT USD H	-5.57%	0.05%	3.31%	23.23%
B2	-7.37%	-3.60%	-0.78%	48.20%
C	-7.11%	-3.08%	-0.22%	56.31%
C2	-7.07%	-3.05%	-0.21%	56.87%
CT USD H	-5.81%	-0.43%	2.83%	19.50%
I	-6.62%	-2.09%	0.76%	73.00%
I2	-6.64%	-2.11%	0.80%	73.53%
I2 CHF H	-6.78%	-2.48%	0.40%	12.80%
I2 GBP H	-7.68%	-2.55%	1.89%	12.20%
I2 USD H	-5.29%	0.59%	3.89%	25.20%
IT USD H	-5.26%	0.72%	3.74%	27.20%
NT USD H	-5.79%	-0.35%	2.78%	19.94%
S	-6.26%	-1.25%	1.66%	88.80%
S1	-6.53%	-1.84%	1.08%	77.67%
S1 USD H	-5.17%	0.88%	4.11%	29.53%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
US Small and Mid-Cap Portfolio				
Klasse				
A	-22.71%	-15.61%	-12.81%	77.00%
A AUD H	-6.47%(3)	–	–	-6.47%
A EUR H	-24.72%	-18.91%	-15.41%	64.67%
A SGD H	-24.22%	-17.59%	-13.72%	37.47%
B	-23.09%	-16.45%	-13.66%	59.87%
C	-22.86%	-15.96%	-13.19%	69.20%
C EUR H	-24.89%	-19.26%	-15.79%	57.93%
I	-22.37%	-14.90%	-12.09%	92.27%
I EUR H	-24.44%	-18.26%	-14.71%	77.87%
S	-21.96%	-13.99%	-11.25%	113.47%
S EUR H	-24.00%	-17.40%	-13.86%	97.53%
S1	-22.24%	-14.64%	-11.86%	97.87%
S1 EUR H	-24.30%	-18.00%	-14.52%	83.40%
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio				
Klasse				
A	-8.66%	-3.63%	-6.70%	-4.33%
A AUD H	-11.31%	-7.23%	-7.66%	10.33%
A CAD H	-10.16%	-5.72%	-8.03%	4.40%
A CHF H	-10.28%	-6.88%	-9.90%	-19.73%
A EUR H	-10.06%	-6.57%	-9.64%	-16.53%
A GBP H	-10.45%	-6.51%	-8.79%	-12.00%
A SGD H	-9.48%	-4.95%	-7.72%	3.73%
AD	-8.64%	-3.65%	-6.66%	3.53%
AD AUD H	-11.30%	-7.13%	-7.69%	2.91%
AD CAD H	-10.11%	-5.71%	-8.01%	-2.31%
AD EUR H	-10.13%	-6.56%	-9.62%	-8.26%
AD GBP H	-10.51%	-6.49%	-8.85%	-4.12%
AD RMB H	-8.52%	-3.74%	–	-8.40%
AD SGD H	-9.46%	-4.92%	-7.73%	4.13%
AD ZAR H	-8.32%	-1.46%	-4.15%	46.41%
AR	-8.66%	-3.67%	-6.71%	2.85%
AR EUR H	-10.10%	-6.56%	-9.61%	-5.16%
B	-9.07%	-4.58%	-7.59%	-12.47%
BD	-9.03%	-4.60%	-7.59%	-3.60%
C	-8.80%	-4.04%	-7.11%	-8.07%
ED	-9.09%	-4.61%	-7.63%	-13.54%
ED AUD H	-11.79%	-13.35%(4)	–	-13.35%
ED ZAR H	-8.71%	-7.64%(5)	–	-7.64%
I	-8.25%	-2.83%	-5.97%	3.00%
I CHF H	-9.86%	-6.12%	-9.19%	-14.07%
I EUR H	-9.77%	-5.86%	-8.90%	-10.07%
I GBP	-3.92%	-6.73%(1)	–	-6.73%
I GBP H	-10.10%	-5.79%	-8.07%	-5.60%
ID	-8.26%	-2.90%	-5.94%	16.81%
ID GBP H	-10.11%	-5.70%	-8.12%	-14.54%
N	-8.89%	-4.12%	-7.05%	-2.27%
S	-7.81%	-1.92%	-5.03%	12.47%
S GBP H	-9.68%	-4.85%	-7.16%	15.07%
S1	-8.19%	-2.73%	-5.78%	4.67%
S1 JPY	-9.55%	-3.19%	-6.16%	-11.48%
S1 JPY H	-9.25%	-4.98%	-8.32%	-15.10%
S1D	-8.19%	-2.69%	-5.77%	-11.12%
SD	-7.83%	-1.95%	-5.01%	24.92%
SQD GBP H	-9.63%	-4.78%	-7.22%	18.28%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
RMB Income Plus Portfolio				
Klasse				
A2	0.34%	2.46%	5.12%	39.77%
AR EUR	-2.71%	-0.63%	2.01%	7.25%
AT	0.34%	2.46%	5.12%	39.80%
C2	0.11%	2.01%	4.64%	34.31%
CT	0.12%	2.00%	4.63%	34.45%
I2	0.62%	3.02%	5.69%	46.89%
IT	0.61%	3.02%	5.70%	47.16%
S	0.99%	3.77%	6.47%	56.80%
S1	0.71%	3.21%	5.88%	49.18%
W2	0.69%	3.19%	5.87%	9.56%
Short Duration High Yield Portfolio				
Klasse				
A2	-2.19%	1.05%	4.73%	34.20%
A2 CHF H	-3.88%	-2.28%	1.25%	5.73%
A2 EUR H	-3.74%	-1.86%	1.72%	19.93%
A2 GBP H	-4.07%	-1.67%	2.84%	25.73%
AA	-2.14%	1.07%	4.74%	16.82%
AA AUD H	-4.26%	-1.77%	4.03%	19.20%
AA SGD H	-2.88%	0.08%	3.85%	12.66%
AR EUR H	-3.72%	-1.81%	1.67%	3.57%
AT	-2.18%	1.11%	4.74%	34.25%
AT AUD H	-4.27%	-1.69%	4.11%	39.58%
AT CAD H	-3.16%	-0.31%	3.69%	24.56%
AT EUR H	-3.79%	-1.90%	1.72%	19.65%
AT GBP H	-4.02%	-1.63%	2.77%	25.61%
AT SGD H	-2.86%	0.06%	3.87%	27.88%
B2	-2.64%	0.11%	3.72%	22.87%
BT	-2.68%	0.03%	3.70%	22.86%
BT CAD H	-3.60%	-1.25%	2.58%	15.00%
C2	-2.42%	0.62%	4.23%	28.93%
CT	-2.40%	0.63%	4.26%	20.17%
I2	-1.90%	1.64%	5.32%	40.80%
I2 CHF H	-3.61%	-1.72%	1.75%	10.27%
I2 EUR H	-3.53%	-1.41%	2.30%	25.73%
I2 GBP H	-3.79%	-1.15%	3.36%	31.93%
IT	-1.87%	1.67%	5.32%	31.11%
IT EUR H	-3.41%	-1.28%	2.28%	7.48%
IT GBP H	-3.54%	-0.85%	3.29%	12.46%
IT SGD H	-2.66%	0.57%	4.45%	17.00%
N2	-2.44%	0.52%	4.17%	17.07%
NT	-2.42%	0.50%	4.15%	17.09%
S	-1.57%	2.31%	6.06%	50.33%
S1	-1.82%	1.84%	5.54%	43.67%
S1QD EUR H	-3.38%	-3.29%(6)	–	-3.29%
W2 CHF H	-3.58%	-1.59%	2.03%	-1.13%
Select US Equity Portfolio				
Klasse				
A	-4.16%	8.85%	1.22%	141.13%
A AUD H	-8.27%	3.49%	0.29%	20.47%
A CHF H	-5.93%	5.11%	-2.02%	42.67%
A CZK H	-6.70%	5.56%	-0.83%	1.30%
A EUR H	-5.77%	5.54%	-1.83%	114.67%
A GBP H	-6.61%	5.07%	-1.09%	122.40%
A PLN H	-6.36%	5.81%	–	1.69%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
Select US Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
A SGD H	-5.38%	7.06%	0.16%	126.40%
AR	-4.17%	8.86%	1.18%	43.84%
AR EUR H	-5.79%	5.55%	-1.88%	30.74%
C	-4.38%	8.34%	0.76%	109.53%
F	-3.48%	10.43%	2.67%	160.40%
F EUR H	-5.07%	7.13%	-0.43%	128.47%
I	-3.80%	9.69%	2.02%	158.13%
I CHF H	-5.53%	5.96%	-1.21%	50.40%
I EUR H	-5.38%	6.38%	-1.04%	130.00%
I GBP H	-6.24%	5.90%	-0.27%	138.27%
I SGD H	-5.00%	7.91%	0.97%	80.00%
N	-4.36%	8.33%	0.76%	100.20%
S	-3.21%	10.99%	3.21%	185.60%
S EUR H	-5.20%	7.20%	0.11%	153.93%
S GBP H	-5.68%	7.14%	0.90%	164.27%
S1	-3.58%	10.15%	2.45%	167.60%
S1 EUR H	-5.08%	6.97%	-0.68%	140.33%
S1 GBP H	-6.05%	6.33%	0.11%	147.40%
S1 JPY	-5.00%	9.63%	–	2.58%
S1 JPY H	-4.66%	7.61%	–	3.40%
S1 SGD H	-4.99%	8.15%	1.37%	29.14%
W	-3.41%	10.52%	2.59%	54.73%
W CHF H	-5.09%	6.97%	-0.72%	38.07%
W EUR H	-5.04%	7.12%	-0.51%	39.47%
W GBP H	-5.80%	6.35%	0.30%	41.87%
W SGD H	-4.57%	8.66%	1.53%	48.87%
Global Plus Fixed Income Portfolio				
Klasse				
1	1.17%	4.55%	6.12%	83.80%
1 EUR H	-0.04%	1.91%	3.01%	60.33%
1 GBP H	-0.11%	2.41%	4.31%	78.53%
1D	1.14%	4.50%	6.15%	76.91%
1D EUR H	-0.06%	1.93%	3.07%	52.91%
1D GBP H	-0.19%	2.33%	4.27%	73.75%
2	1.21%	4.60%	6.21%	84.80%
2 EUR H	-0.04%	1.94%	3.09%	60.93%
2 GBP H	-0.11%	2.48%	4.34%	79.07%
A2	0.94%	4.06%	5.66%	28.20%
A2 EUR H	-0.35%	1.42%	2.48%	14.73%
A2 SGD H	0.47%	3.29%	4.79%	12.93%
AR EUR H	-0.38%	1.35%	2.62%	4.17%
AT	0.92%	4.06%	5.65%	28.31%
AT AUD H	-0.46%	2.02%	5.21%	33.67%
AT CAD H	0.29%	3.05%	4.78%	23.20%
AT EUR H	-0.35%	1.36%	2.52%	15.06%
AT GBP H	-0.44%	1.90%	3.72%	17.96%
AT SGD H	0.50%	3.30%	4.82%	21.90%
BT	0.41%	3.05%	4.56%	18.32%
BT CAD H	-0.18%	2.01%	3.76%	13.95%
C2	0.71%	3.57%	5.17%	23.67%
C2 EUR H	-0.54%	0.97%	2.10%	11.07%
CT	0.71%	3.58%	5.19%	14.15%
I2	1.26%	4.68%	6.18%	34.27%
I2 EUR H	0.11%	2.09%	3.14%	20.67%
I2 GBP H	-0.16%	2.47%	4.37%	27.40%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
Global Plus Fixed Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
IK EUR H	-0.11%	1.90%	3.14%	6.87%
S	1.56%	5.37%	7.03%	34.73%
S CAD H	0.94%	4.38%	6.13%	11.91%
S GBP H	0.27%	3.24%	5.20%	67.07%
S1	1.30%	4.85%	6.48%	29.80%
S1 EUR H	0.00%	2.13%	3.39%	57.93%
SA	1.59%	5.40%	6.99%	12.53%
Select Absolute Alpha Portfolio				
Klasse				
A	-1.82%	4.63%	1.16%	40.27%
A AUD H	-3.38%	2.20%	0.44%	23.93%
A CHF H	-2.91%	1.91%	-2.24%	6.67%
A EUR H	-2.95%	2.05%	-1.96%	29.20%
A GBP H	-2.90%	2.35%	-0.91%	33.73%
A PLN H	-2.34%	3.98%	–	1.82%
A SGD H	-2.09%	3.95%	0.30%	40.40%
C	-1.96%	4.28%	0.94%	26.73%
F	-1.31%	6.66%	2.69%	65.53%
F EUR H	-2.43%	4.07%	-0.41%	50.00%
I	-1.75%	5.02%	1.86%	49.27%
I CHF H	-2.78%	2.44%	-1.62%	12.13%
I EUR H	-2.90%	2.45%	-1.33%	36.33%
I GBP H	-2.52%	3.11%	-0.73%	39.27%
N	-1.90%	4.32%	0.93%	20.67%
S	-1.33%	7.85%	3.54%	83.13%
S EUR H	-2.45%	5.15%	0.39%	64.80%
S GBP H	-2.61%	5.23%	1.33%	71.73%
S1	-1.74%	6.79%	1.45%	54.07%
S1 EUR H	-2.63%	3.19%	-1.09%	38.07%
S1 GBP H	-2.48%	3.20%	-0.14%	44.00%
S1 JPY H	-2.18%	3.72%	-0.84%	22.33%
S13 EUR H	-2.78%	-0.21%(7)	–	-0.21%
W	-1.35%	5.58%	2.21%	7.20%
W CHF H	-2.59%	2.74%	-0.81%	0.13%
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio				
Klasse				
A2	-2.78%	2.33%	-2.42%	-9.07%
A2 CZK H	-4.66%	0.04%	-4.41%	-14.57%
A2 EUR H	-4.11%	-0.50%	-5.53%	-20.67%
A2 PLN H	-4.04%	0.43%	–	-1.56%
AA	-2.85%	2.31%	–	5.83%
AT	-2.80%	-1.21%(8)	–	-1.21%
AT SGD H	-3.58%	1.06%	-3.38%	3.18%
I2	-2.53%	2.96%	-1.91%	-4.80%
I2 EUR H	-3.86%	0.00%	-5.11%	-17.07%
S	-2.02%	3.95%	-0.73%	3.47%
S1	-2.39%	3.23%	-1.52%	-2.07%
SA	-6.39%(9)	–	–	-6.39%
ZT	-1.93%	4.14%	-0.69%	11.25%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio				
Klasse				
A2	-1.06%	3.93%	1.31%	18.13%
A2 AUD H	-2.21%	2.04%	0.54%	26.93%
A2 EUR H	-2.42%	1.09%	-1.71%	4.93%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
A2 SGD H	-1.55%	3.06%	0.48%	14.47%
AA	-1.07%	3.87%	1.31%	5.16%
AA AUD H	-2.27%	1.95%	0.50%	2.19%
AA CAD H	-1.69%	2.82%	0.38%	2.53%
AA EUR H	-2.41%	1.16%	-1.72%	-2.55%
AA GBP H	-2.14%	1.99%	-0.45%	0.17%
AA SGD H	-1.50%	3.13%	0.40%	2.75%
AR EUR H	-2.33%	1.17%	-1.65%	0.65%
AT	-1.03%	3.92%	1.38%	18.23%
AT AUD H	-2.28%	1.90%	0.61%	26.90%
AT CAD H	-1.67%	2.81%	0.30%	13.88%
AT EUR H	-2.35%	1.22%	-1.69%	4.76%
AT GBP H	-2.09%	1.92%	-0.48%	9.66%
AT SGD H	-1.52%	3.08%	0.35%	14.52%
B2	-1.57%	2.84%	0.32%	8.47%
BT	-1.60%	2.86%	0.35%	8.65%
BT AUD H	-2.69%	1.03%	-0.50%	16.54%
BT CAD H	-2.07%	1.86%	-0.65%	5.46%
BT EUR H	-2.91%	0.11%	-2.68%	-4.43%
BT GBP H	-2.49%	1.06%	-1.48%	1.62%
C2	-1.27%	3.45%	0.86%	13.80%
C2 EUR H	-2.57%	0.66%	-2.08%	0.93%
I2	-0.80%	4.45%	1.89%	23.67%
I2 EUR H	-2.08%	1.79%	-1.16%	9.80%
I2 SGD H	-1.26%	3.69%	0.99%	20.07%
IT	-0.79%	4.53%	1.80%	23.64%
IT AUD H	-2.04%	2.54%	1.12%	24.08%
IT EUR H	-2.03%	1.80%	-1.12%	9.58%
IT SGD H	-1.25%	3.68%	0.96%	17.36%
S	-0.35%	5.43%	2.82%	33.33%
S1	-0.68%	4.76%	2.15%	26.27%
Emerging Market Corporate Debt Portfolio				
Klasse				
A2	-3.83%	-0.59%	5.21%	33.87%
A2 AUD H	-6.40%	-3.83%	4.51%	30.67%
A2 CAD H	-5.06%	-2.28%	4.21%	22.60%
A2 EUR H	-5.17%	-3.28%	2.09%	19.87%
A2 GBP H	-5.80%	-3.41%	3.18%	17.00%
A2 SGD H	-4.65%	-1.72%	4.27%	21.73%
AA	-3.84%	-0.61%	5.17%	21.64%
AA AUD H	-6.44%	-3.87%	4.47%	22.83%
AA SGD H	-4.62%	-1.70%	4.32%	13.31%
AR EUR	-4.58%	0.05%	10.07%	17.93%
AT	-3.91%	-0.67%	5.14%	17.99%
AT AUD H	-6.40%	-3.81%	4.49%	30.83%
AT CAD H	-5.03%	-2.23%	4.17%	22.17%
AT EUR H	-5.23%	-3.28%	2.07%	11.99%
AT GBP H	-5.79%	-3.42%	3.22%	17.00%
AT NZD H	-5.72%	-3.03%	4.61%	34.92%
AT RMB H	-3.74%	-0.42%	5.58%	38.68%
AT SGD H	-4.60%	-1.69%	4.30%	21.79%
C2	-4.08%	-1.02%	4.65%	15.87%
CT	-4.06%	-1.04%	4.74%	14.29%
I2	-3.58%	0.00%	5.73%	40.13%
I2 EUR H	-4.91%	-2.70%	2.55%	25.20%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
Emerging Market Corporate Debt Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
IT	-3.63%	-0.03%	5.66%	22.88%
N2	-4.11%	-1.09%	4.55%	15.13%
NT	-4.07%	-1.11%	4.56%	14.99%
S	-3.09%	1.01%	6.83%	52.73%
S1	-3.39%	0.32%	6.10%	44.20%
US High Yield Portfolio				
Klasse				
A2	-2.83%	1.21%	2.37%	39.67%
A2 EUR H	-4.54%	-1.89%	-0.63%	24.60%
C2	-3.07%	0.75%	1.91%	7.53%
I2	-2.58%	1.72%	2.97%	46.00%
I2 EUR H	-4.30%	-1.36%	-0.10%	30.47%
N2	-3.07%	0.64%	1.82%	5.07%
NT	-3.09%	0.67%	1.81%	4.63%
S1	-2.38%	2.13%	3.18%	50.13%
S1 EUR H	-4.11%	-3.80%(10)	–	-3.80%
ZT	-2.08%	2.76%	3.94%	9.76%
Low Volatility Equity Portfolio				
Klasse				
A	-7.16%	2.45%	4.09%	89.40%
A AUD H	-10.18%	-1.53%	3.46%	62.87%
A EUR	-7.92%	1.60%(11)	–	1.60%
A EUR H	-8.29%	-0.19%	1.07%	70.27%
A NZD H	-9.94%	-1.13%	3.35%	68.53%
A PLN H	-8.75%	0.15%	–	-0.92%
A SGD H	-8.13%	1.03%	3.15%	56.67%
AD	-7.13%	2.44%	4.13%	61.68%
AD AUD H	-10.23%	-1.59%	3.46%	61.98%
AD CAD H	-9.24%	-0.25%	2.81%	44.38%
AD EUR H	-8.30%	-0.22%	1.05%	36.61%
AD GBP H	-9.25%	-0.74%	1.94%	40.04%
AD NZD H	-9.91%	-1.03%	3.32%	68.20%
AD RMB H	-7.08%	2.57%	–	1.00%
AD SGD H	-8.12%	1.04%	3.15%	56.63%
AD ZAR H	-7.06%	0.72%(12)	–	0.72%
AR	-7.18%	2.43%	4.10%	26.53%
AR EUR H	-8.25%	-0.20%	0.85%	15.37%
C	-7.37%	1.99%	3.63%	29.93%
ED	-7.62%	1.46%	–	8.25%
ED AUD H	-10.62%	-5.68%(13)	–	-5.68%
ED ZAR H	-7.22%	-5.34%(14)	–	-5.34%
I	-6.80%	3.29%	4.92%	101.07%
I EUR	-7.52%	2.47%(11)	–	2.47%
I EUR H	-7.94%	0.59%	1.90%	80.20%
I GBP	-2.38%	3.73%(11)	–	3.73%
I GBP H	-8.91%	0.00%	2.81%	22.00%
I SGD H	-7.73%	1.88%	4.01%	55.07%
N	-7.35%	1.98%	3.68%	30.27%
S	-6.39%	4.17%	5.75%	114.73%
S EUR H	-7.54%	1.47%	2.77%	93.00%
S1	-6.62%	3.64%	5.34%	107.07%
S1 EUR	-7.32%	2.87%(11)	–	2.87%
S1 EUR H	-7.75%	0.98%	2.26%	85.67%
S1D	-6.64%	-3.14%(15)	–	-3.14%
SD	-6.40%	4.14%	–	5.72%

Klasse	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio				
A	-8.74%	-3.66%	-11.63%	14.20%
AD	-8.70%	-3.60%	-11.69%	-19.83%
AD AUD H	-11.41%	-7.31%	-12.46%	-23.69%
AD CAD H	-10.38%	-5.86%	-12.68%	-22.84%
AD EUR H	-9.93%	-6.21%	-14.46%	-25.07%
AD GBP H	-10.31%	-6.22%	-13.46%	-24.00%
AD NZD H	-10.74%	-6.23%	-12.41%	-22.67%
AD SGD H	-9.55%	-4.86%	-12.57%	-21.90%
F	-8.06%	-2.23%	-10.34%	-12.04%
F EUR H	-9.24%	-4.78%	-13.19%	-18.27%
I	-8.35%	-2.86%	-10.96%	20.00%
I GBP H	-0.10%	-5.48%	-12.79%	-18.40%
I SGD H	-9.16%	-4.08%	-11.85%	-15.33%
S	-7.88%	-1.84%	-9.96%	27.80%
S EUR	-8.34%(16)	–	–	-8.34%
S GBP	-3.50%	0.51%	-5.30%	58.13%
S1	-8.25%	-2.62%	-10.64%	21.53%
Global Dynamic Bond Portfolio				
A2 CHF H	-1.63%	-1.16%	0.07%	-3.40%
A2 EUR H	-1.52%	-0.86%	0.40%	-0.67%
A2 SGD H	-0.80%	0.87%	2.69%	7.73%
A2 USD H	-0.36%	1.72%	3.49%	10.60%
AR EUR H	-1.55%	-0.89%	0.43%	-1.08%
I2	-1.28%	0.31%	2.27%	8.27%
I2 CHF H	-1.39%	-0.73%	0.60%	-0.40%
I2 EUR H	-1.22%	-0.32%	1.04%	2.87%
I2 USD H	-0.06%	2.27%	4.11%	14.00%
S	-0.83%	1.16%	3.09%	51.00%
S EUR H	-0.86%	0.44%	1.83%	7.80%
S USD H	0.56%	3.32%	4.93%	20.27%
S1	-1.01%	0.73%	2.67%	10.87%
S1 EUR H	-0.94%	0.19%	1.35%	5.33%
S1 SGD H	-0.37%	1.57%(17)	–	1.57%
S1 USD H	0.06%	2.63%	4.46%	17.00%
S1QD	-1.05%	0.76%	–	2.75%
SQD	-0.86%	1.13%	3.13%	8.09%
Concentrated US Equity Portfolio				
A	-0.10%	15.16%	11.16%	98.07%
A AUD H	-4.18%	9.68%	9.60%	98.67%
A EUR	-0.83%	15.97%	16.32%	91.73%
A EUR H	-2.05%	11.39%	7.98%	81.87%
A SGD H	-1.35%	13.30%	9.81%	95.33%
AR EUR	-0.85%	15.94%	16.32%	75.65%
C	-0.31%	14.65%	10.68%	92.53%
I	0.29%	16.10%	12.05%	108.67%
I AUD H	-4.02%	10.37%	10.53%	108.53%
I CHF H	-1.69%	11.97%	8.40%	85.87%
I EUR H	-1.75%	12.19%	8.83%	90.87%
I GBP	5.00%	6.47%(8)	–	6.47%
I GBP H	-2.73%	11.63%	9.55%	94.60%
I SGD H	-0.93%	14.24%	10.82%	105.87%
N	-0.31%	14.65%	10.68%	92.53%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
Concentrated US Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S	0.75%	17.18%	13.16%	122.40%
S EUR H	-1.30%	13.26%	9.87%	103.33%
S1	0.41%	16.31%	12.31%	111.53%
S1 EUR H	-1.66%	12.43%	9.04%	93.53%
S1 GBP H	-2.64%	11.79%	9.88%	65.00%
SD	0.76%	17.20%	–	29.23%
Concentrated Global Equity Portfolio				
Klasse				
A	-0.91%	11.97%	3.28%	80.80%
A EUR H	-2.29%	8.91%	0.18%	62.13%
A SGD H	-1.84%	10.46%	2.12%	49.20%
AR EUR	-1.64%	12.69%	8.08%	56.17%
C	-1.11%	11.48%	2.80%	30.73%
I	-0.52%	12.89%	4.07%	90.40%
I CAD H	-2.18%	10.43%	2.52%	34.87%
I CHF H	-2.01%	9.43%	0.75%	65.60%
I EUR	-1.27%	3.33%(18)	–	3.33%
I EUR H	-1.95%	9.72%	0.99%	70.87%
I GBP	4.16%	6.73%(8)	–	6.73%
I GBP H	-2.83%	9.24%	1.83%	74.13%
N	-1.14%	11.54%	2.81%	44.33%
S	0.03%	14.10%	5.25%	104.47%
S EUR H	-1.40%	10.95%	2.14%	83.13%
S GBP	4.77%	16.83%	10.65%	122.60%
S1	-0.38%	13.15%	4.32%	93.27%
S1 EUR H	-1.81%	9.99%	1.29%	73.20%
Global Core Equity Portfolio				
Klasse				
A	-6.47%	4.34%	0.90%	33.00%
A AUD H	-10.63%	-1.08%	-0.36%	28.33%
A EUR H	-7.41%	1.88%	-2.39%	19.13%
A SGD H	-7.59%	2.62%	-0.32%	28.20%
AR EUR	-7.10%	5.05%	5.59%	35.52%
C	-6.63%	3.90%	0.43%	29.60%
I	-6.06%	5.23%	1.69%	39.60%
I AUD H	-10.34%	-0.40%	0.45%	34.13%
I CHF H	-6.76%	2.86%	-1.60%	22.40%
I EUR	-6.81%	-3.33%(10)	–	-3.33%
I EUR H	-7.07%	2.69%	-1.62%	24.53%
I GBP H	-8.66%	1.27%	-0.53%	27.20%
I SGD H	-7.18%	3.54%	0.46%	34.47%
IX EUR	-6.61%	6.21%	6.75%	202.84%
N	-6.68%	3.90%	0.43%	29.53%
RX EUR	-7.20%	4.85%	5.38%	168.69%
S	-5.62%	6.23%	2.65%	47.87%
S EUR H	-6.63%	3.65%	-0.67%	32.33%
S GBP H	-8.27%	2.20%	0.47%	45.67%
S NOK HP	-9.02%	-9.11%(19)	–	-9.11%
S1	-5.89%	5.58%	2.07%	42.60%
S1 EUR H	-7.18%	2.70%	-1.49%	26.73%
S1 NOK HP	25.45%(20)	–	–	25.45%
SD	-5.58%	6.23%	–	5.19%

Klasse	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
Global Income Portfolio				
A2	-2.12%	1.89%	6.16%	7.73%
A2 AUD H	-3.92%	-0.51%	5.72%	3.00%
A2 CAD H	-3.10%	0.45%	5.29%	4.07%
A2 CHF H	-3.63%	-1.28%	2.49%	-2.60%
A2 EUR H	-3.45%	-0.87%	2.96%	-1.00%
A2 GBP H	-3.70%	-0.59%	4.32%	0.73%
A2 PLN H	-3.25%	0.32%	–	1.85%
A2 SGD H	-2.69%	1.04%	5.26%	3.73%
AA	-2.08%	1.92%	6.18%	7.11%
AA AUD H	-4.00%	-0.58%	5.68%	4.12%
AA CAD H	-3.14%	0.50%	5.21%	4.33%
AA EUR H	-3.45%	-0.81%	2.99%	-0.11%
AA SGD H	-2.62%	1.06%	5.23%	4.87%
AT	-2.08%	1.92%	6.16%	7.77%
AT AUD H	-3.93%	-0.56%	5.75%	3.03%
AT CAD H	-3.15%	0.48%	5.24%	4.10%
AT EUR H	-3.48%	-0.89%	3.00%	-1.52%
AT GBP H	-3.66%	-0.50%	4.26%	0.81%
AT SGD H	-2.71%	0.99%	5.23%	3.67%
I2	-1.79%	2.49%	6.72%	9.60%
I2 AUD H	-3.72%	0.00%	6.27%	5.13%
I2 CAD H	-2.89%	1.02%	5.74%	5.47%
I2 CHF H	-3.39%	-0.74%	3.11%	-1.20%
I2 EUR H	-3.27%	-0.33%	3.62%	0.67%
I2 GBP H	-3.43%	0.00%	4.80%	3.33%
I2 SGD H	-2.40%	1.54%	5.89%	5.80%
IT	-1.79%	2.43%	6.75%	9.51%
IT AUD H	-3.72%	-0.02%	6.31%	5.13%
IT CAD H	-2.87%	1.05%	5.76%	5.49%
IT EUR H	-3.15%	-0.30%	3.61%	0.80%
IT SGD H	-2.45%	1.52%	5.79%	5.72%
S	-1.47%	3.21%	7.46%	11.93%
S EUR H	-2.84%	0.43%	4.32%	2.67%
S GBP H	-3.10%	0.68%	5.58%	4.68%
S1	-1.70%	2.70%	6.94%	10.26%
S1 EUR H	-3.11%	-0.08%	3.79%	1.37%
S1 GBP H	-3.31%	0.24%	5.02%	3.39%
Alternative Risk Premia Portfolio				
F	-4.04%	-2.61%	-0.47%	-6.14%
F EUR H	-5.13%	-5.02%	-3.49%	-12.37%
F GBP H	-5.10%	-4.41%	-2.28%	-10.21%
I	-4.26%	-2.99%	-0.90%	-7.13%
I EUR H	-5.31%	-5.38%	-3.91%	-13.27%
I GBP H	-5.33%	-4.79%	-2.78%	-11.20%
S	-3.85%	-2.18%	-0.11%	-5.24%
S1	-4.18%	-2.85%	-0.82%	-6.86%
S1 EUR H	-5.25%	-5.29%	-3.77%	-13.01%
S1 GBP H	-5.26%	-4.71%	-2.62%	-10.94%
S3 AUD H	-5.12%	-4.88%(21)	–	-4.88%
European Equity Portfolio				
A	-19.16%	-9.95%	-9.10%	43.00%
A AUD H	-21.12%	-11.50%	-7.29%	26.73%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
European Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
A HKD H	-20.08%(22)	–	–	-20.08%
A SGD H	-18.94%	-8.70%	-7.28%	21.00%
A USD H	-18.10%	-7.36%	-6.29%	24.27%
AD	-19.19%	-9.96%	-9.14%	13.95%
AD AUD H	-21.17%	-11.54%	-7.32%	26.93%
AD SGD H	-18.91%	-8.70%	-7.26%	20.82%
AD USD H	-18.10%	-7.35%	-6.31%	24.18%
B	-19.61%	-10.83%	-10.02%	18.50%
BD AUD H	-21.53%	-12.45%	-8.20%	18.75%
BD USD H	-18.52%	-8.23%	-7.24%	20.33%
C	-19.38%	-10.33%	-9.53%	88.70%
C USD H	-18.26%	-7.74%	-6.71%	12.80%
I	-18.90%	-9.26%	-8.34%	79.40%
I GBP	-14.37%	-13.80%(10)	–	-13.80%
I USD H	-17.74%	-6.56%	-5.51%	19.60%
S	-18.48%	-8.38%	-7.50%	49.82%
S1	-18.70%	-8.90%	-8.05%	-8.98%
S1 GBP	-14.22%	-13.58%(10)	–	-13.58%
S1NN	2.34%(23)	–	–	2.34%
S1X	-18.68%	-8.85%	-8.01%	31.32%
SD	-18.46%	-8.35%	-7.51%	30.08%
Eurozone Equity Portfolio				
Klasse				
A	-20.94%	-12.04%	-7.45%	50.00%
A AUD H	-23.48%	-14.25%	-5.59%	27.53%
A PLN H	-21.15%	-11.58%	–	-15.73%
A SGD H	-20.91%	-11.08%	-5.62%	26.33%
A USD H	-20.05%	-9.64%	-4.64%	30.00%
AR	-20.93%	-12.03%	–	-19.67%
AX	-20.94%	-12.00%	-7.38%	15.90%
BX	-21.36%	-12.89%	-8.33%	-6.10%
C	-21.13%	-12.40%	-7.87%	43.60%
C USD H	-20.23%	-10.10%	-5.10%	19.33%
CX	-21.09%	-12.34%	-7.81%	-16.20%
I	-20.65%	-11.34%	-6.70%	62.13%
I GBP	-16.24%	-14.40%(8)	–	-14.40%
I USD H	-19.73%	-8.96%	-3.82%	26.67%
INN	-20.60%	-11.31%	–	-13.70%
IX	-20.64%	-11.31%	-6.63%	37.30%
S	-20.25%	-10.46%	-5.81%	13.73%
S1	-20.50%	-11.01%	-6.45%	67.00%
S1 GBP	-16.12%	-15.85%(24)	–	-15.85%
S1 USD H	-19.58%	-8.63%	-3.60%	41.87%
S1N	-20.44%	-10.92%	–	-11.32%
S1N USD	-19.85%	-11.29%	–	-11.62%
American Growth Portfolio				
Klasse				
A	11.69%	28.76%	6.96%	555.43%
A EUR H	10.26%	25.35%	3.74%	303.54%
A PLN H	10.42%	26.58%	–	20.63%
A SGD H	3.07%(25)	–	–	3.07%
AD	11.70%	28.79%	6.97%	134.19%
AD AUD H	8.30%	24.02%	5.58%	134.84%
AD RMB H	11.76%	28.85%	–	20.81%

Klasse	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
American Growth Portfolio (Fortsetzung)				
AD ZAR H	12.34%	32.39%	10.38%	215.73%
AX	12.03%	29.52%	7.59%	1311.30%
B	11.16%	27.50%	5.89%	419.55%
BD	11.15%	27.52%	5.91%	121.39%
BD ZAR H	11.68%	31.00%	9.19%	195.53%
BX	12.02%	29.52%	7.58%	1184.23%
C	11.46%	28.18%	6.49%	852.33%
C EUR H	9.97%	24.78%	3.25%	288.14%
ED	11.17%	27.48%	5.84%	36.14%
I	12.14%	29.80%	7.80%	709.72%
I EUR H	10.67%	26.35%	4.61%	338.27%
I GBP	17.43%	17.20%(26)	–	17.20%
I GBP H	10.04%	18.40%(27)	–	18.40%
N	11.45%	28.17%	6.50%	104.47%
S	14.27%(28)	–	–	14.27%
S EUR H	11.18%	27.50%	5.49%	83.00%
S1	12.31%	30.16%	8.10%	401.84%
S1 EUR H	10.80%	26.66%	–	24.64%
SD	12.67%	31.01%	8.81%	171.53%
SK	12.28%	30.08%	8.05%	330.90%
All Market Income Portfolio				
A	-13.01%	-7.39%	2.55%	7.00%
A CHF H	-14.34%	-10.29%	-0.76%	-6.40%
A EUR H	-14.40%	-10.14%	-0.37%	-3.73%
A HKD	-13.86%	-8.45%	2.56%	7.21%
A SGD H	-13.71%	-8.45%	1.73%	4.07%
A2X	-12.84%	-7.05%	2.80%	38.93%
AD	-12.98%	-7.37%	2.59%	7.26%
AD AUD H	-15.33%	-10.44%	1.84%	6.01%
AD CAD H	-14.31%	-9.17%	1.59%	2.17%
AD EUR H	-14.38%	-10.16%	-0.48%	-4.26%
AD GBP H	-14.73%	-9.99%	0.62%	-0.50%
AD HKD	-13.85%	-8.45%	2.57%	7.20%
AD NZD H	-14.82%	-9.69%	1.99%	8.83%
AD RMB H	-5.51%(3)	–	–	-5.51%
AD SGD H	-13.74%	-8.48%	1.74%	4.12%
AD ZAR H	-12.59%	-4.86%	6.75%	34.87%
AMG	-13.01%	-7.39%	–	-6.01%
AMG EUR H	-14.35%	-10.11%	–	-10.60%
ANN	-12.97%	-7.39%	–	-5.97%
ANN EUR H	-14.33%	-10.06%	–	-10.59%
AQG	-12.96%	-7.36%	–	-5.97%
AQG EUR H	-14.38%	-10.09%	–	-10.59%
AR EUR H	-14.32%	-10.03%	-0.48%	-7.29%
AX	-12.83%	-7.05%	2.78%	39.18%
B	-13.42%	-8.34%	1.60%	1.07%
B2X	-13.27%	-8.04%	1.78%	18.93%
BX	-13.30%	-7.98%	1.75%	19.07%
C	-13.20%	-7.84%	2.12%	3.47%
C2X	-13.05%	-7.51%	2.34%	29.67%
CD	-13.16%	-7.77%	2.11%	4.20%
CX	-13.03%	-7.52%	2.38%	29.67%
ED	-13.40%	-8.33%	–	-4.03%
ED AUD H	-15.69%	-11.26%	–	-11.54%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
All Market Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
ED ZAR H	-13.07%	-5.93%	–	-6.12%
I	-12.66%	-6.68%	3.40%	11.73%
I CHF H	-14.08%	-9.62%	0.06%	-2.33%
I EUR H	-14.02%	-9.38%	0.36%	0.53%
I SGD H	-13.36%	-7.71%	2.56%	8.53%
ID	-12.63%	-6.63%	3.35%	12.02%
IMG	-12.67%	-6.64%	–	-4.73%
IMG EUR H	-14.00%	-9.33%	–	-9.40%
INN	-12.57%	-6.60%	–	-4.67%
INN EUR H	-13.95%	-9.31%	–	-9.35%
INN GBP H	-14.34%	-9.22%	–	-8.66%
IQG	-12.63%	-6.63%	–	-4.73%
IQG EUR H	-14.03%	-9.41%	–	-9.43%
N	-13.22%	-7.87%	2.16%	4.60%
ND	-13.23%	-7.85%	2.14%	4.71%
S1	-12.58%	-6.47%	3.62%	8.87%
S1 CHF H	-13.91%	-9.35%	–	-9.48%
S1 EUR H	-13.94%	-9.18%	–	-9.10%
S1 GBP H	-14.22%	-8.98%	–	-8.31%
S1D JPY H	-13.54%	-8.64%	–	-6.06%
S1QG GBP H	-14.27%	-9.04%	–	-8.36%
China A Shares Equity Portfolio				
Klasse				
A	-0.11%	7.44%	–	7.93%
A AUD H	-4.93%(29)	–	–	-4.93%
A CAD H	-4.00%(29)	–	–	-4.00%
A EUR	-3.10%	4.41%	–	4.20%
A HKD H	4.37%(30)	–	–	4.37%
A NZD H	-4.07%(29)	–	–	-4.07%
A SGD H	-3.53%(29)	–	–	-3.53%
A USD	-1.96%	4.16%	–	3.47%
A USD H	4.33%(30)	–	–	4.33%
AD HKD	2.65%(30)	–	–	2.65%
AD HKD H	4.36%(30)	–	–	4.36%
AD SGD H	4.05%(30)	–	–	4.05%
AD USD H	4.33%(30)	–	–	4.33%
I	0.30%	8.32%	–	10.34%
I GBP	3.14%	7.46%	–	9.53%
I USD H	4.53%(30)	–	–	4.53%
S	0.79%	9.40%	–	52.48%
S USD	-9.50%(31)	–	–	-9.50%
S1	0.43%	8.56%	–	8.45%
S1 EUR	-5.51%(32)	–	–	-5.51%
SP1 USD	-3.43%(33)	-	–	-3.43%
Financial Credit Portfolio				
Klasse				
A2	-4.57%	5.24%	6.25%	8.53%
A2 CHF H	-6.35%	1.67%	2.75%	1.27%
A2 EUR H	-6.63%	1.54%	3.10%	1.40%
AT	-4.61%	5.20%	6.28%	8.52%
I2	-4.36%	5.78%	6.87%	9.73%
I2 CHF H	-6.11%	2.20%	3.37%	2.40%
I2 EUR H	-6.51%	1.99%	3.65%	2.47%
I2 GBP H	-7.49%	1.44%	4.75%	3.00%

	6 Monate*	12 Monate	Vorjahr	Seit Auflegung
Financial Credit Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
IT	-4.38%	5.75%	6.87%	9.72%
S	-3.93%	6.68%	7.67%	11.54%
S EUR H	-6.05%	2.92%	4.44%	4.19%
S GBP H	-7.25%	2.09%	5.54%	4.51%
S1	-4.20%	6.12%	7.13%	10.38%
S1 EUR H	-6.28%	2.41%	3.90%	3.13%
S1 GBP H	-7.48%	1.58%	5.00%	3.43%
ZT	-3.93%	6.69%	7.77%	11.64%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio				
Klasse				
A2	0.80%	1.13%(34)	–	1.13%
I2	1.08%	5.71%	–	6.07%
I2 GBP H	0.73%	1.13%(34)	–	1.13%
I2 USD H	2.72%	3.13%(34)	–	3.13%
S	1.31%	6.18%	–	6.57%
S1	1.09%	5.73%	–	6.11%
S1 GBP H	0.77%	1.17%(34)	–	1.17%
S1 USD H	2.77%	3.18%(34)	–	3.18%

Die Wertentwicklung der Anteilklassen der einzelnen Portefeuilles basiert auf dem Nettoinventarwert zum 31. Mai 2020, 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, die bei der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen anfallen. 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 31. Mai 2020.

Rendite berechnet ab Auflegungsdatum am:

(1) 7. November 2019
(2) 3. Dezember 2019
(3) 10. März 2020
(4) 4. November 2019
(5) 28. Juni 2019
(6) 26. November 2019
(7) 18. Oktober 2019
(8) 22. August 2019
(9) 21. Januar 2019
(10) 26. September 2019
(11) 6. Juni 2019
(12) 7. August 2019
(13) 16. August 2019
(14) 6. November 2019
(15) 11. Oktober 2019
(16) 4. Dezember 2019
(17) 3. Juni 2019
(18) 24. Juli 2019
(19) 18. November 2019
(20) 16. März 2020
(21) 12. Juni 2019
(22) 27. Dezember 2019
(23) 7. Mai 2020

(24) 24. Oktober 2019

(25) 11. Februar 2020. Die Anteilklasse wurde am 14. Oktober 2019 aufgelegt, am 2. Januar 2020 vollständig zurückgenommen und am 12. Februar 2020 neu aufgelegt.

(26) 1. August 2019

(27) 19. Juni 2019

(28) 15. April 2019

(29) 12. Dezember 2019

(30) 18. März 2020

(31) 6. Januar 2020

(32) 9. März 2020

(33) 6. Dezember 2019

(34) 14. November 2019

	Zinssatz	Datum	Anteile		Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE						
STAMMAKTIEN						
GESUNDHEITSWESEN						
BIOTECHNOLOGIE						
Alexion Pharmaceuticals, Inc.			150,830	$	18,084,517	1.6%
Amgen, Inc.			187,330		43,029,701	3.9
CSL Ltd.			125,470		23,236,269	2.1
Galapagos NV (Sponsored ADR)			15,870		3,218,119	0.3
Genmab A/S			26,640		8,248,485	0.7
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.			56,330		34,519,587	3.1
Vertex Pharmaceuticals, Inc.			206,821		59,556,175	5.4
					189,892,853	17.1
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF						
ABIOMED, Inc.			80,590		18,044,101	1.6
Align Technology, Inc.			96,120		23,608,994	2.1
Carl Zeiss Meditec AG			73,410		7,512,184	0.7
Cochlear Ltd.			72,320		9,327,086	0.8
Coloplast A/S - Class B			55,030		9,307,516	0.8
Edwards Lifesciences Corp.			142,050		31,921,476	2.9
Fisher & Paykel Healthcare Corp., Ltd.			355,690		6,631,679	0.6
IDEXX Laboratories, Inc.			106,900		33,019,272	3.0
Intuitive Surgical, Inc.			62,050		35,990,861	3.3
iRhythm Technologies, Inc.			69,790		8,675,595	0.8
Medtronic PLC			316,977		31,247,593	2.8
Penumbra, Inc.			28,040		4,834,657	0.4
Siemens Healthineers AG			116,990		6,074,239	0.6
Straumann Holding AG			9,000		7,340,090	0.7
Stryker Corp.			77,960		15,259,111	1.4
Sysmex Corp.			100,000		8,024,973	0.7
					256,819,427	23.2
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN						
Cigna Corp.			189,610		37,413,845	3.4
Fleury SA			646,100		2,827,134	0.3
Quest Diagnostics, Inc.			136,150		16,103,822	1.4
UnitedHealth Group, Inc.			283,810		86,519,478	7.8
					142,864,279	12.9
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE						
Veeva Systems, Inc. - Class A			151,610		33,182,881	3.0
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN						
Illumina, Inc.			89,680		32,558,324	3.0
Lonza Group AG			20,990		10,365,297	0.9
Mettler-Toledo International, Inc.			8,230		6,542,850	0.6
Sartorius Stedim Biotech			58,150		15,827,226	1.4
					65,293,697	5.9
PHARMAZEUTIKA						
Astellas Pharma, Inc.			855,100		15,278,877	1.4
GlaxoSmithKline PLC			1,171,940		24,274,083	2.2
GW Pharmaceuticals PLC (Sponsored ADR)			32,030		3,931,683	0.3
Johnson & Johnson			172,020		25,587,975	2.3
Novo Nordisk A/S - Class B			589,280		38,600,598	3.5
Pfizer, Inc.			1,701,660		64,986,395	5.9
Roche Holding AG			250,967		87,116,110	7.9
Zoetis, Inc.			286,770		39,972,870	3.6
					299,748,591	27.1
					987,801,728	89.2
INFORMATIONSTECHNOLOGIE						
IT-DIENSTLEISTUNGEN						
MAXIMUS, Inc.			222,890		16,052,538	1.4
Gesamtanlagen						
(Kosten $763,463,865)				$	1,003,854,266	90.6%
Termineinlagen						
ANZ, London(a)	0.01 %	–			104,702	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	(0.60)%	–			103,549	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	0.03 %	–			58,471	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	2.75 %	–			27,347	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(a)	(1.39)%	–			100,680	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(a)	(0.67)%	–			104,798	0.0
HSBC Bank PLC, London(a)	0.01 %	–			102,777	0.0
JPMorgan Chase, New York(a)	0.01 %	–			102,748,602	9.3
National Australia Bank, London(a)	0.01 %	–			134,617	0.1

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettovermögen %
SEB, Stockholm(a)	(0.30)%	–	$ 38,602	0.0%
Sumitomo, Tokyo(a)	(0.26)%	–	99,607	0.0
Termineinlagen insgesamt			103,623,752	9.4
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			45,090	0.0
Nettovermögen			$ 1,107,523,108	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	123	EUR	112	6/30/20	$ 1,057

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

EUR – Euro
USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONSAUSRÜSTUNG			
Ciena Corp.	96,780	$ 5,348,063	0.8%
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Cognex Corp.	109,170	6,194,306	0.9
Coherent, Inc.	36,240	5,262,410	0.8
IPG Photonics Corp.	40,110	6,233,094	1.0
Keyence Corp.	24,800	10,215,099	1.5
Murata Manufacturing Co., Ltd.	77,400	4,353,579	0.7
Samsung SDI Co., Ltd.	23,250	6,769,610	1.0
		39,028,098	5.9
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Adyen NV	10,570	13,880,409	2.1
Okta, Inc.	27,910	5,458,638	0.8
PayPal Holdings, Inc.	145,440	22,544,654	3.4
Shopify, Inc. - Class A	7,630	5,782,014	0.8
Twilio, Inc. - Class A	34,340	6,785,584	1.0
Visa, Inc. - Class A	156,400	30,535,536	4.6
		84,986,835	12.7
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Advanced Micro Devices, Inc.	126,890	6,826,682	1.0
Ambarella, Inc.	54,260	3,078,712	0.5
Analog Devices, Inc.	79,770	9,010,021	1.3
Applied Materials, Inc.	156,460	8,789,923	1.3
ASML Holding NV	30,510	9,994,457	1.5
Cree, Inc.	69,900	3,683,031	0.6
Disco Corp.	14,300	3,203,675	0.5
Infineon Technologies AG	400,990	8,451,960	1.3
MediaTek, Inc.	318,000	4,909,776	0.7
Micron Technology, Inc.	100,680	4,823,579	0.7
Monolithic Power Systems, Inc.	19,290	4,046,077	0.6
NVIDIA Corp.	64,750	22,987,545	3.4
Semtech Corp.	99,970	5,316,405	0.8
STMicroelectronics NV	214,520	5,327,591	0.8
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. (Sponsored ADR)	61,420	3,091,269	0.5
Teradyne, Inc.	70,560	4,728,931	0.7
Xilinx, Inc.	79,580	7,317,381	1.1
		115,587,015	17.3
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	43,320	16,747,512	2.5
Anaplan, Inc.	74,050	3,400,376	0.5
ANSYS, Inc.	39,110	11,068,130	1.7
AVEVA Group PLC	87,270	4,434,004	0.7
Crowdstrike Holdings, Inc. - Class A	48,230	4,235,076	0.6
Dassault Systemes SE	44,570	7,609,520	1.1
Datadog, Inc. - Class A	72,220	5,147,119	0.8
DocuSign, Inc.	43,990	6,147,163	0.9
Manhattan Associates, Inc.	60,930	5,386,212	0.8
Microsoft Corp.	255,180	46,761,735	7.0
Salesforce.com, Inc.	107,150	18,728,749	2.8
ServiceNow, Inc.	24,280	9,418,940	1.4
Slack Technologies, Inc. - Class A	103,320	3,621,366	0.6
Trade Desk, Inc. (The) - Class A	17,040	5,308,982	0.8
Zendesk, Inc.	80,010	6,860,858	1.0
		154,875,742	23.2
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	162,571	51,687,824	7.7
Samsung Electronics Co., Ltd.	90,940	3,745,462	0.6
		55,433,286	8.3
		455,259,039	68.2
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Cellnex Telecom SA	128,540	7,212,149	1.1
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	69,260	4,985,335	0.7
Sea Ltd. (ADR)	69,350	5,534,130	0.8
Walt Disney Co. (The)	55,840	6,550,032	1.0
		17,069,497	2.5

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Alphabet, Inc. - Class C			8,730	$ 12,474,472	1.9%
Facebook, Inc. - Class A			31,200	7,022,808	1.1
Match Group, Inc. (a)			59,590	5,305,894	0.8
Tencent Holdings Ltd.			187,000	10,127,147	1.5
Twitter, Inc.			198,820	6,157,455	0.9
Zillow Group, Inc. - Class C			116,030	6,728,580	1.0
				47,816,356	7.2
				72,098,002	10.8
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
Aptiv PLC			89,590	6,750,607	1.0
KRAFTFAHRZEUGE					
Tesla, Inc. (a)			11,250	9,393,750	1.4
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB					
Alibaba Group Holding Ltd.			482,540	12,476,987	1.9
Amazon.com, Inc.			5,990	14,629,796	2.2
Booking Holdings, Inc.			4,150	6,803,593	1.0
Meituan Dianping - Class B			197,800	3,767,308	0.6
MercadoLibre, Inc.			6,540	5,569,922	0.8
Wayfair, Inc. - Class A (a)			24,680	4,233,854	0.6
				47,481,460	7.1
				63,625,817	9.5
GESUNDHEITSWESEN					
BIOTECHNOLOGIE					
Abcam PLC			359,450	6,681,007	1.0
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF					
Intuitive Surgical, Inc.			9,450	5,481,284	0.8
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE					
Veeva Systems, Inc. - Class A			27,300	5,975,151	0.9
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN					
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A			13,590	6,677,039	1.0
Illumina, Inc.			18,530	6,727,316	1.0
				13,404,355	2.0
				31,541,797	4.7
INDUSTRIEGÜTER					
MASCHINEN					
Daifuku Co., Ltd.			64,800	5,069,459	0.8
FANUC Corp.			37,800	6,754,807	1.0
				11,824,266	1.8
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN					
Recruit Holdings Co., Ltd.			157,800	5,435,727	0.8
STRASSE UND SCHIENE					
Uber Technologies, Inc.			100,950	3,666,504	0.6
				20,926,497	3.2
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
SBA Communications Corp.			17,860	5,610,362	0.9
Gesamtanlagen					
(Kosten $445,990,538)				$649,061,514	97.3%
Termineinlagen					
BBH, Grand Cayman(b)	(0.60)%	–		40,964	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	(0.30)%	–		193	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	(0.25)%	–		13,314	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.03 %	–		64,382	0.0
Citibank, New York(b)	0.01 %	–		21,006,804	3.2
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.39)%	–		46,978	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(b)	(0.67)%	–		63,581	0.0
Sumitomo, London(b)	(0.26)%	–		64,203	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	–		58,522	0.0
Termineinlagen insgesamt				21,358,941	3.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(3,173,667)	(0.5)
Nettovermögen				$667,246,788	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,934	PLN	11,844	06/30/2020	$ 18,015

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

PLN – Polish Zloty
USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
IMMOBILIEN			
IMMOBILIENAKTIVITÄTEN – DIVERSIFIZIERT			
City Developments Ltd.	39,900	$ 218,272	0.5%
Mitsubishi Estate Co., Ltd.	24,800	394,181	0.9
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	55,200	1,061,905	2.5
New World Development Co., Ltd.	240,000	243,929	0.6
Sumitomo Realty & Development Co., Ltd.	6,800	188,298	0.5
Sun Hung Kai Properties Ltd.	47,000	550,495	1.3
UOL Group Ltd.	38,300	186,144	0.5
		2,843,224	6.8
REITS – DIVERSIFIZIERT			
Activia Properties, Inc.	58	196,804	0.5
Alexander & Baldwin, Inc.	15,640	178,452	0.4
Armada Hoffler Properties, Inc.	23,030	198,519	0.5
Essential Properties Realty Trust, Inc.	22,819	311,251	0.7
Fibra Uno Administracion SA de CV	99,336	76,200	0.2
Gecina SA	1,940	249,262	0.6
Hulic Reit, Inc.	290	372,075	0.9
Kenedix Office Investment Corp. - Class A	43	237,705	0.6
Mirvac Group	259,400	406,968	1.0
Nippon REIT Investment Corp.	38	133,287	0.3
Stockland	129,020	308,042	0.7
United Urban Investment Corp.	380	402,323	1.0
		3,070,888	7.4
REITS – GESUNDHEITSWESEN			
Assura PLC	545,940	533,512	1.3
Healthpeak Properties, Inc.	30,670	755,709	1.8
Medical Properties Trust, Inc.	32,920	595,194	1.4
Omega Healthcare Investors, Inc.	18,821	586,086	1.4
Physicians Realty Trust	33,070	571,119	1.4
Welltower, Inc.	27,490	1,392,918	3.3
		4,434,538	10.6
REITS – HOTELS UND RESORTS			
Japan Hotel REIT Investment Corp.	164	68,234	0.2
Park Hotels & Resorts, Inc.	25,610	251,746	0.6
RLJ Lodging Trust	26,230	270,432	0.6
		590,412	1.4
REITS – INDUSTRIE			
Americold Realty Trust	20,380	727,770	1.7
Dream Industrial Real Estate Investment Trust	28,998	213,981	0.5
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	161	264,494	0.6
Nippon Prologis REIT, Inc.	145	408,653	1.0
Prologis, Inc.	22,620	2,069,730	5.0
Rexford Industrial Realty, Inc.	6,990	278,202	0.7
Segro PLC	53,810	559,169	1.3
STAG Industrial, Inc.	18,550	498,995	1.2
		5,020,994	12.0
REITS – BÜROS			
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	5,525	849,303	2.0
Allied Properties Real Estate Investment Trust	10,500	305,044	0.7
Boston Properties, Inc.	9,050	778,119	1.9
CapitaLand Commercial Trust	334,300	415,323	1.0
Cousins Properties, Inc.	16,582	516,032	1.2
Daiwa Office Investment Corp.	39	226,966	0.6
Easterly Government Properties, Inc.	10,660	267,246	0.7
Inmobiliaria Colonial Socimi SA	23,040	208,320	0.5
Japan Real Estate Investment Corp.	46	250,375	0.6
Kilroy Realty Corp.	8,210	468,955	1.1
Mori Hills REIT Investment Corp.	162	218,328	0.5
Nippon Building Fund, Inc.	21	131,337	0.3
True North Commercial Real Estate Investment Trust	19,450	77,130	0.2
		4,712,478	11.3
IMMOBILIENENTWICKLUNG			
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	222,000	161,274	0.4
CK Asset Holdings Ltd.	104,500	573,972	1.4
Instone Real Estate Group AG	12,510	272,098	0.6
		1,007,344	2.4
IMMOBILIEN-BETRIEBSGESELLSCHAFTEN			
Aroundtown SA	76,826	422,548	1.0
Azrieli Group Ltd.	3,580	188,770	0.5

		Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
	CA Immobilien Anlagen AG	10,109	$ 341,786	0.8%
	Deutsche Wohnen SE	11,940	534,653	1.3
	Entra ASA	39,701	537,875	1.3
	Fabege AB	32,220	392,355	0.9
	Grainger PLC	100,860	359,738	0.9
	Kojamo Oyj	8,590	175,144	0.4
	LEG Immobilien AG	2,700	337,853	0.8
	PSP Swiss Property AG REG	2,660	302,833	0.7
	Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB	96,070	194,043	0.5
	Swire Properties Ltd.	98,400	220,786	0.5
	Vonovia SE	20,525	1,180,558	2.8
	Wharf Real Estate Investment Co., Ltd.(a)	48,000	186,138	0.5
	Wihlborgs Fastigheter AB	19,140	309,562	0.7
			5,684,642	13.6
IMMOBILIEN-DIENSTLEISTUNGEN				
	Unibail-Rodamco-Westfield	3,155	167,055	0.4
REITS – WOHNRAUM				
	American Campus Communities, Inc.	14,070	454,461	1.1
	American Homes 4 Rent - Class A	26,200	661,288	1.6
	Bluerock Residential Growth REIT, Inc.	11,590	74,524	0.2
	Camden Property Trust	5,470	500,888	1.2
	Comforia Residential REIT, Inc.	61	184,078	0.5
	Essex Property Trust, Inc.	3,465	841,198	2.0
	Independence Realty Trust, Inc.	39,361	389,280	0.9
	Japan Rental Housing Investments, Inc.	229	209,700	0.5
	Killam Apartment Real Estate Investment Trust	37,770	464,152	1.1
	Mid-America Apartment Communities, Inc.	6,950	808,702	1.9
	Northview Apartment Real Estate Investment Trust	8,160	205,830	0.5
	Sun Communities, Inc.	6,087	835,076	2.0
			5,629,177	13.5
REITS – EINZELHANDEL				
	AEON REIT Investment Corp.	136	143,807	0.3
	Agree Realty Corp.	5,279	331,363	0.8
	Brixmor Property Group, Inc.	56,630	631,991	1.5
	Link REIT	72,500	547,497	1.3
	Realty Income Corp.	16,660	921,464	2.2
	Retail Properties of America, Inc. - Class A	91,380	495,280	1.2
	Simon Property Group, Inc.	3,220	185,794	0.5
	SITE Centers Corp.	44,200	250,614	0.6
	Vicinity Centres	291,680	313,773	0.8
			3,821,583	9.2
REITS – SPEZIALISIERT				
	CubeSmart	16,590	472,151	1.1
	Digital Realty Trust, Inc.	7,624	1,094,501	2.6
	MGM Growth Properties LLC - Class A	17,352	481,171	1.2
	National Storage Affiliates Trust	20,860	626,009	1.5
	Public Storage	1,180	239,233	0.6
	Safestore Holdings PLC	25,030	207,406	0.5
			3,120,471	7.5
			40,102,806	96.1
TRANSPORT				
SCHNELLSTRASSEN UND BAHNGLEISE				
	Transurban Group	51,277	489,764	1.2
GEBRAUCHSGÜTER UND BEKLEIDUNG				
HAUSBAU				
	Persimmon PLC	6,810	194,248	0.4
	PulteGroup, Inc.	8,270	280,932	0.7
			475,180	1.1
SOFTWARE UND DIENSTLEISTUNGEN				
INTERNETDIENSTE UND INFRASTRUKTUR				
	GDS Holdings Ltd. (ADR)	3,110	177,270	0.4
VERBRAUCHERDIENSTE				
FREIZEITEINRICHTUNGEN				
	Planet Fitness, Inc.	1,820	117,627	0.3
GRUNDSTOFFE				
BAUMATERIAL				
	Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV	25,450	91,163	0.2

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Gesamtanlagen				
(Kosten $46,470,783)			$ 41,453,810	99.3%
Termineinlagen				
Barclays, London(b)	0.01 %	–	237,609	0.6
BBH, Grand Cayman(b)	(1.39)%	–	4,530	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	(0.30)%	–	4,089	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	(0.26)%	–	3,987	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	(0.25)%	–	12,269	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.01 %	–	17,920	0.1
BBH, Grand Cayman(b)	0.03 %	–	11,433	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.04 %	–	7,644	0.0
Sumitomo, London(b)	(0.67)%	–	53,420	0.1
Termineinlagen insgesamt			352,901	0.8
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			(63,672)	(0.1)
Nettovermögen			$ 41,743,039	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	854	USD	512	06/15/2020	$ (56,584)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	220	USD	149	06/15/2020	2,088
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	174	USD	130	06/15/2020	4,074
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	319	USD	230	06/15/2020	(2,546)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	211	USD	216	06/15/2020	(3,180)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	110	USD	117	06/15/2020	2,469
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	290	USD	324	06/15/2020	2,467
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	1,086	USD	1,192	06/15/2020	(14,527)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	293	USD	373	06/15/2020	11,566
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS	464	USD	127	06/15/2020	(4,681)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	49,103	USD	458	06/15/2020	2,580
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	71,880	USD	651	06/15/2020	(15,401)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	2,886	USD	145	06/15/2020	14,866
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK	3,022	USD	297	06/15/2020	(13,035)
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK	3,314	USD	360	06/15/2020	18,588
Brown Brothers Harriman & Co.	SGD	449	USD	310	06/15/2020	(7,825)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	661	AUD	1,074	06/15/2020	54,877
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	188	CAD	262	06/15/2020	2,532
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	446	CHF	422	06/15/2020	(7,165)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	189	CHF	183	06/15/2020	1,374
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	762	EUR	673	06/15/2020	(14,663)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	923	EUR	849	06/15/2020	19,621
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	194	GBP	149	06/15/2020	(10,779)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	178	GBP	144	06/15/2020	222
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	816	JPY	88,877	06/15/2020	7,782
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	868	JPY	92,293	06/15/2020	(11,767)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	290	NOK	2,974	06/15/2020	16,247
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	270	SGD	388	06/15/2020	4,325
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	363	USD	234	09/14/2020	(8,208)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	177	USD	217	09/14/2020	(1,992)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	16,371	USD	153	09/14/2020	819
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	10,193	USD	94	09/14/2020	(45)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	116	AUD	180	09/14/2020	3,865
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	186	EUR	169	09/14/2020	1,947
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	25	GBP	20	09/14/2020	31
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	345	JPY	36,825	09/14/2020	(3,048)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	322	AUD	495	06/12/2020	8,144
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	263	NZD	431	06/12/2020	4,605
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	36	SGD	52	06/12/2020	99
Citibank, NA	USD	566	SGD	796	06/15/2020	(2,627)
HSBC Bank USA	CNH	2,143	USD	304	06/15/2020	3,723
Royal Bank of Scotland PLC	JPY	60,187	USD	566	06/15/2020	7,377
						$ 18,215
					Wertsteigerung	$ 196,288
					Wertminderung	$ (178,073)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
ILS – Israeli Shekel
JPY – Japanese Yen
MXN – Mexican Peso
NOK – Norwegian Krone
NZD – New Zealand Dollar
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

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

	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Flex Ltd.	1,361,172	$ 13,216,981	1.6%
Keyence Corp.	37,644	15,505,392	1.8
		28,722,373	3.4
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Adyen NV	17,161	22,536,108	2.7
Pagseguro Digital Ltd.	368,222	11,683,683	1.4
Square, Inc. - Class A	147,116	11,928,161	1.4
Visa, Inc. - Class A	80,517	15,720,112	1.9
		61,868,064	7.4
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Cree, Inc.	253,996	13,383,030	1.6
Infineon Technologies AG	839,501	17,694,773	2.1
NVIDIA Corp.	40,208	14,274,629	1.7
NXP Semiconductors NV	113,346	10,892,560	1.3
		56,244,992	6.7
SOFTWARE			
Dassault Systemes SE	100,798	17,209,468	2.1
Microsoft Corp.	89,965	16,486,008	2.0
Proofpoint, Inc.	103,797	12,068,528	1.4
Zendesk, Inc.	134,111	11,500,055	1.4
		57,264,059	6.9
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	54,987	17,482,599	2.1
		221,582,087	26.5
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Abcam PLC	706,663	13,134,568	1.6
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Danaher Corp.	90,698	15,111,132	1.8
Koninklijke Philips NV	448,771	20,402,457	2.4
West Pharmaceutical Services, Inc.	87,630	18,931,484	2.3
		54,445,073	6.5
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	677,747	12,132,489	1.4
Laboratory Corp. of America Holdings	85,875	15,055,555	1.8
UnitedHealth Group, Inc.	40,929	12,477,130	1.5
		39,665,174	4.7
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	50,811	24,964,653	3.0
Bruker Corp.	256,015	11,080,313	1.3
Gerresheimer AG	251,724	21,537,645	2.6
ICON PLC	59,983	10,104,081	1.2
Tecan Group AG (REG)	52,785	18,489,267	2.2
		86,175,959	10.3
		193,420,774	23.1
INDUSTRIEGÜTER			
BAUPRODUKTE			
Kingspan Group PLC	9,270	571,640	0.1
Kingspan Group PLC (London)	280,570	17,334,012	2.1
Trex Co., Inc.	102,119	12,266,539	1.4
		30,172,191	3.6
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Waste Management, Inc.	124,771	13,319,333	1.6
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Schneider Electric SE (Paris)	139,458	13,808,119	1.7
Vestas Wind Systems A/S	183,555	18,747,507	2.2
		32,555,626	3.9
MASCHINEN			
Xylem, Inc./NY	221,637	14,703,411	1.8
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Recruit Holdings Co., Ltd.	375,304	12,928,091	1.5
		103,678,652	12.4

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
FINANZWERTE					
BANKEN					
Erste Group Bank AG			403,438	$ 8,923,608	1.1%
HDFC Bank Ltd.			747,828	9,423,838	1.1
				18,347,446	2.2
KAPITALMÄRKTE					
Charles Schwab Corp. (The)			221,208	7,943,576	0.9
MSCI, Inc. - Class A			72,334	23,787,141	2.8
Partners Group Holding AG			17,593	14,655,879	1.8
				46,386,596	5.5
VERSICHERUNGEN					
AIA Group Ltd.			1,368,757	11,231,726	1.4
				75,965,768	9.1
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Chr Hansen Holding A/S			234,570	22,780,292	2.7
Ecolab, Inc.			72,691	15,452,641	1.8
Koninklijke DSM NV			121,117	15,492,682	1.9
				53,725,615	6.4
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
Aptiv PLC			173,598	13,080,583	1.6
KRAFTFAHRZEUGE					
Tesla, Inc.			12,121	10,120,620	1.2
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB					
Alibaba Group Holding Ltd.			504,829	13,053,307	1.5
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER					
NIKE, Inc. - Class B			172,132	16,968,819	2.0
				53,223,329	6.3
VERBRAUCHSGÜTER					
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Kerry Group PLC - Class A			128,839	15,756,057	1.9
HAUSHALTSPRODUKTE					
Procter & Gamble Co. (The)			122,432	14,192,262	1.7
Unicharm Corp.			195,105	7,285,403	0.8
				21,477,665	2.5
				37,233,722	4.4
VERSORGUNG					
WASSERVERSORGER					
American Water Works Co., Inc.			110,816	14,073,602	1.7
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Tencent Holdings Ltd.			245,863	13,314,929	1.6
Gesamtanlagen					
(Kosten $564,102,612)				$766,218,478	91.5%
Termineinlagen					
ANZ, London(a)	0.01 %	–		60,829,346	7.3
BBH, Grand Cayman(a)	(0.60)%	–		77,453	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	(0.30)%	–		7,625	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	(0.25)%	–		3	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	0.01 %	–		1,996	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	0.03 %	–		74,959	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	0.04 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	2.75 %	–		1	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(a)	(1.39)%	–		82,094	0.0
HSBC France S.A., Paris(a)	(0.67)%	–		162,171	0.0
Sumitomo, London(a)	0.01 %	–		75,159	0.0
Sumitomo, Tokyo(a)	(0.26)%	–		75,526	0.0
Sumitomo, Tokyo(a)	0.01 %	–		582,913	0.1
Termineinlagen insgesamt				61,969,247	7.4
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				9,394,659	1.1
Nettovermögen				$837,582,384	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	USD	7,863	AUD	12,402	06/15/2020	$ 403,499
Bank of America, NA	USD	1,418	EUR	1,312	06/15/2020	39,246
Bank of America, NA	USD	10,874	JPY	1,197,524	06/15/2020	231,974
Bank of America, NA	USD	1,747	JPY	188,080	06/15/2020	(3,009)
Barclays Bank PLC	CNH	10,967	USD	1,533	06/15/2020	(2,167)
Barclays Bank PLC	CNH	6,025	USD	849	06/15/2020	5,384
Barclays Bank PLC	EUR	13,203	USD	14,573	06/15/2020	(86,150)
Barclays Bank PLC	GBP	1,900	USD	2,372	06/15/2020	25,205
Barclays Bank PLC	GBP	3,180	USD	3,907	06/15/2020	(20,781)
Barclays Bank PLC	JPY	765,975	USD	7,022	06/15/2020	(81,318)
Barclays Bank PLC	JPY	308,169	USD	2,880	06/15/2020	21,155
Barclays Bank PLC	USD	972	CHF	920	06/15/2020	(15,162)
Barclays Bank PLC	USD	3,432	CNH	24,151	06/15/2020	(51,751)
Barclays Bank PLC	USD	21,443	GBP	17,005	06/15/2020	(441,530)
Barclays Bank PLC	USD	1,729	JPY	180,395	06/15/2020	(56,224)
Barclays Bank PLC	USD	7,481	JPY	809,710	06/15/2020	28,175
Barclays Bank PLC	USD	4,926	SEK	47,730	06/15/2020	140,289
Barclays Bank PLC	INR	544,651	USD	6,937	07/23/2020	(237,234)
Barclays Bank PLC	EUR	6,888	USD	7,528	09/14/2020	(135,253)
BNP Paribas SA	USD	5,454	BRL	29,327	06/02/2020	42,208
BNP Paribas SA	USD	3,089	EUR	2,801	06/15/2020	21,627
BNP Paribas SA	USD	2,028	GBP	1,710	06/15/2020	84,898
BNP Paribas SA	ZAR	16,969	USD	1,024	06/15/2020	58,443
BNP Paribas SA	BRL	29,327	USD	5,445	07/02/2020	(41,971)
BNP Paribas SA	INR	340,895	USD	4,381	07/23/2020	(109,421)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	4,068	USD	4,442	06/15/2020	(74,806)
Brown Brothers Harriman & Co.	HKD	21,575	USD	2,781	06/15/2020	(2,006)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	4,116	EUR	3,781	06/15/2020	82,956
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	4,133	HKD	32,070	06/15/2020	3,284
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	7,079	JPY	757,962	06/15/2020	(49,965)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	1,360	AUD	2,075	09/14/2020	23,273
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5,984	AUD	9,235	06/12/2020	171,173
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10	CAD	13	06/12/2020	152
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	385	EUR	355	06/12/2020	9,055
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	415	SGD	588	06/12/2020	1,146
Citibank, NA	BRL	10,579	USD	1,873	06/02/2020	(109,738)
Citibank, NA	CNH	11,386	USD	1,618	06/15/2020	23,832
Citibank, NA	EUR	21,999	USD	23,981	06/15/2020	(445,372)
Citibank, NA	EUR	5,972	USD	6,708	06/15/2020	76,650
Citibank, NA	GBP	2,282	USD	2,753	06/15/2020	(65,555)
Citibank, NA	HKD	28,042	USD	3,607	06/15/2020	(9,865)
Citibank, NA	JPY	115,234	USD	1,072	06/15/2020	2,828
Citibank, NA	USD	13,336	CAD	18,453	06/15/2020	66,424
Citibank, NA	USD	2,212	CNH	15,486	06/15/2020	(44,124)
Citibank, NA	USD	14,921	EUR	13,402	06/15/2020	(40,430)
Citibank, NA	USD	3,951	EUR	3,630	06/15/2020	79,662
Citibank, NA	USD	757	HKD	5,873	06/15/2020	468
Citibank, NA	USD	9,425	JPY	1,001,661	06/15/2020	(135,713)
Citibank, NA	USD	3,813	ZAR	63,434	06/15/2020	(203,887)
Citibank, NA	INR	122,311	USD	1,559	07/23/2020	(51,785)
Citibank, NA	USD	9,472	KRW	11,586,477	08/13/2020	(71,858)
Citibank, NA	CHF	1,438	USD	1,497	09/14/2020	(2,982)
Citibank, NA	EUR	3,861	USD	4,256	09/14/2020	(38,742)
Credit Suisse International	AUD	2,790	USD	1,624	06/15/2020	(235,534)
Credit Suisse International	CHF	5,256	USD	5,392	06/15/2020	(75,012)
Credit Suisse International	EUR	7,649	USD	8,329	06/15/2020	(163,829)
Credit Suisse International	USD	1,452	CNH	10,284	06/15/2020	(12,393)
Credit Suisse International	USD	6,933	EUR	6,411	06/15/2020	185,089
Goldman Sachs Bank USA	CNH	12,245	USD	1,721	06/15/2020	7,155
Goldman Sachs Bank USA	EUR	7,962	USD	8,648	06/15/2020	(192,509)
Goldman Sachs Bank USA	JPY	142,735	USD	1,336	06/15/2020	12,456
Goldman Sachs Bank USA	JPY	472,999	USD	4,309	06/15/2020	(77,930)
Goldman Sachs Bank USA	USD	6,950	AUD	10,903	06/15/2020	317,976
Goldman Sachs Bank USA	USD	2,806	GBP	2,259	06/15/2020	(16,474)
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,139	JPY	121,279	06/15/2020	(14,249)
Goldman Sachs Bank USA	USD	6,686	JPY	728,829	06/15/2020	73,715
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,962	MXN	44,400	06/15/2020	35,869
HSBC Bank USA	MXN	22,062	USD	873	06/15/2020	(119,560)
HSBC Bank USA	USD	8,460	CNH	59,470	06/15/2020	(135,275)
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	3,595	USD	3,976	06/15/2020	(16,285)
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	1,120	USD	1,386	06/15/2020	2,800
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	4,809	CAD	6,782	06/15/2020	117,146
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	1,210	CHF	1,177	06/15/2020	15,082

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	3,794	EUR	3,504	06/15/2020	$ 96,773
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	1,840	INR	140,329	07/23/2020	8,146
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	3,815	CAD	5,257	09/14/2020	3,193
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL	18,748	USD	3,340	06/02/2020	(172,986)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY	238,697	USD	2,224	06/15/2020	10,047
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	14,216	EUR	13,067	06/15/2020	292,662
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,939	HKD	15,043	06/15/2020	942
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,969	JPY	212,083	06/15/2020	(2,537)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	2,142	RUB	159,984	07/14/2020	113,981
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	10,295	TWD	303,645	08/20/2020	(106,386)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,345	JPY	144,817	09/14/2020	78
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,687	JPY	178,596	09/14/2020	(27,861)
Royal Bank of Scotland PLC	AUD	2,723	USD	1,709	06/15/2020	(105,587)
Royal Bank of Scotland PLC	CAD	2,964	USD	2,049	06/15/2020	(103,920)
Royal Bank of Scotland PLC	CNH	10,900	USD	1,532	06/15/2020	6,285
Royal Bank of Scotland PLC	EUR	89,650	USD	100,391	06/15/2020	848,703
Royal Bank of Scotland PLC	GBP	1,253	USD	1,566	06/15/2020	18,585
Royal Bank of Scotland PLC	JPY	166,304	USD	1,507	06/15/2020	(35,244)
Royal Bank of Scotland PLC	JPY	788,640	USD	7,411	06/15/2020	96,657
Royal Bank of Scotland PLC	USD	2,460	GBP	2,054	06/15/2020	76,448
Royal Bank of Scotland PLC	USD	1,916	GBP	1,473	06/15/2020	(96,860)
Royal Bank of Scotland PLC	USD	2,978	JPY	322,073	06/15/2020	9,020
Royal Bank of Scotland PLC	CHF	2,119	USD	2,193	09/14/2020	(17,009)
Royal Bank of Scotland PLC	EUR	7,052	USD	7,710	09/14/2020	(135,866)
Royal Bank of Scotland PLC	USD	1,353	GBP	1,106	09/14/2020	13,210
Standard Chartered Bank	USD	1,540	CNH	10,964	09/14/2020	(13,293)
State Street Bank & Trust Co.	HKD	26,627	USD	3,430	06/15/2020	(3,743)
State Street Bank & Trust Co.	USD	1,210	CNH	8,572	06/15/2020	(9,676)
State Street Bank & Trust Co.	EUR	3,791	USD	4,123	09/14/2020	(94,121)
UBS AG	CHF	920	USD	977	06/15/2020	20,551
UBS AG	GBP	1,942	USD	2,255	06/15/2020	(142,824)
UBS AG	JPY	101,975	USD	937	06/15/2020	(8,450)
UBS AG	JPY	236,061	USD	2,212	06/15/2020	23,035
UBS AG	USD	1,543	CAD	2,140	06/15/2020	10,833
						$ (704,769)
					Wertsteigerung	$ 4,059,443
					Wertminderung	$ (4,764,212)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) 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
INR – Indian Rupee
JPY – Japanese Yen
KRW – South Korean Won
MXN – Mexican Peso
RUB – Russian Ruble
SEK – Swedish Krona
SGD – Singapore Dollar
TWD – New Taiwan Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

REG – Registered Shares

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
FINANZWERTE			
BANKEN			
HDFC Bank Ltd.	917,017	$ 11,485,716	8.6%
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
Manappuram Finance Ltd.	2,704,166	4,477,365	3.4
Muthoot Finance Ltd.	667,820	7,595,262	5.7
Repco Home Finance Ltd.	1,113,379	1,351,670	1.0
		13,424,297	10.1
VERSICHERUNGEN			
Bajaj Finserv Ltd.	8,338	484,355	0.4
HDFC Life Insurance Co., Ltd.	126,319	863,328	0.7
Max Financial Services Ltd.	596,661	3,773,307	2.8
		5,120,990	3.9
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG			
Housing Development Finance Corp., Ltd.	363,849	8,021,242	6.0
		38,052,245	28.6
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONSAUSRÜSTUNG			
Sterlite Technologies Ltd.	1,745,427	2,199,781	1.7
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Infosys Ltd.	1,174,546	10,748,825	8.1
Tata Consultancy Services Ltd.	367,981	9,639,906	7.2
Tech Mahindra Ltd.	514,170	3,607,596	2.7
Vakrangee Ltd.	4,285,721	1,504,781	1.1
		25,501,108	19.1
		27,700,889	20.8
INDUSTRIEGÜTER			
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Larsen & Toubro Ltd.	160,385	1,972,566	1.5
Voltas Ltd.	663,850	4,201,285	3.1
		6,173,851	4.6
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
KEI Industries Ltd.	446,274	1,649,561	1.2
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
L&T Technology Services Ltd.	115,413	1,770,507	1.3
Quess Corp., Ltd.	256,630	748,683	0.6
		2,519,190	1.9
STRASSE UND SCHIENE			
VRL Logistics Ltd.	706,009	1,375,768	1.0
TRANSPORTWESEN – INFRASTRUKTUR			
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	142,021	614,165	0.5
		12,332,535	9.2
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
MEDIEN			
Zee Entertainment Enterprises Ltd.	1,512,830	3,641,215	2.7
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Bharti Airtel Ltd.	800,311	5,820,059	4.4
		9,461,274	7.1
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Petronet LNG Ltd.	667,820	2,256,499	1.7
Reliance Industries Ltd.	308,470	5,996,739	4.5
		8,253,238	6.2
VERBRAUCHSGÜTER			
HAUSHALTSPRODUKTE			
Hindustan Unilever Ltd.	120,565	3,279,907	2.5
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Colgate-Palmolive India Ltd.	1,729	31,668	0.0
TABAK			
ITC Ltd.	1,699,201	4,429,108	3.3
		7,740,683	5.8
VERSORGUNG			
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
Indraprastha Gas Ltd.	647,163	3,954,035	3.0

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
Mahanagar Gas Ltd.			182,780	$ 2,354,358	1.7%
				6,308,393	4.7
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB					
MakeMyTrip Ltd.			172,760	2,676,053	2.0
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
Embassy Office Parks REIT			428,600	1,884,018	1.4
				114,409,328	85.8
BEZUGSRECHTE					
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Reliance Industries Ltd., expiring 12/31/2049			23,889	70,451	0.1
Gesamtanlagen					
(Kosten $134,743,869)				$ 114,479,779	85.9%
Termineinlagen					
JPMorgan Chase, New York(a)	0.01 %	–		2,890,918	2.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				15,881,756	11.9
Nettovermögen				$ 133,252,453	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	598	AUD	908	06/22/2020	$ 7,244
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6	PLN	25	06/22/2020	183
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	137	SGD	194	06/22/2020	186
						$ 7,613

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Chemours Co. (The)	4.00%	05/15/2026	EUR	1,490	€ 1,281,921	0.4%
Constellium SE	4.25%	02/15/2026		1,477	1,378,094	0.4
INEOS Styrolution Group GmbH	2.25%	01/16/2027		1,367	1,269,701	0.4
K&S AG	3.25%	07/18/2024		4,400	3,620,091	1.0
Kraton Polymers LLC/Kraton Polymers Capital Corp.	5.25%	05/15/2026		2,336	2,293,922	0.6
Kronos International, Inc.	3.75%	09/15/2025		2,031	1,993,000	0.6
LANXESS AG	4.50%	12/06/2076		1,079	1,117,122	0.3
OCI NV	3.13%	11/01/2024		1,878	1,848,917	0.5
SGL Carbon SE	4.63%	09/30/2024		816	610,515	0.2
Smurfit Kappa Acquisitions ULC	2.88%	01/15/2026		1,472	1,522,165	0.4
Smurfit Kappa Treasury ULC	1.50%	09/15/2027		719	686,951	0.2
Solvay Finance SA(a)	5.87%	06/03/2024		2,165	2,329,459	0.7
Starfruit Finco BV/Starfruit US Holdco LLC	6.50%	10/01/2026		587	575,295	0.2
thyssenkrupp AG	1.88%	03/06/2023		1,457	1,370,037	0.4
thyssenkrupp AG	2.50%	02/25/2025		4,510	4,139,497	1.2
thyssenkrupp AG	2.88%	02/22/2024		544	511,442	0.1
Vallourec SA	2.25%	09/30/2024		1,900	1,033,844	0.3
Vallourec SA	6.38%	10/15/2023		999	603,959	0.2
Vallourec SA	6.63%	10/15/2022		445	287,313	0.1
WEPA Hygieneprodukte GmbH	2.88%	12/15/2027		1,478	1,467,929	0.4
					29,941,174	8.6
INVESTITIONSGÜTER						
ARD Finance SA(b)	5.00%	06/30/2027		3,000	2,836,823	0.8
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.75%	07/15/2027	GBP	1,541	1,659,836	0.5
Crown European Holdings SA	2.88%	02/01/2026	EUR	823	827,679	0.2
Crown European Holdings SA	3.38%	05/15/2025		2,283	2,351,721	0.7
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	4.75%	04/15/2024		1,160	1,119,418	0.3
OI European Group BV	3.13%	11/15/2024		1,534	1,511,543	0.4
Paprec Holding SA	4.00%	03/31/2025		1,819	1,583,822	0.5
Titan Global Finance PLC	2.38%	11/16/2024		1,000	990,592	0.3
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026		3,125	3,063,975	0.9
					15,945,409	4.6
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Altice Financing SA	2.25%	01/15/2025		2,090	1,997,520	0.6
Altice Financing SA	3.00%	01/15/2028		701	659,389	0.2
Altice Finco SA	4.75%	01/15/2028		1,385	1,240,180	0.3
Banijay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025		739	711,030	0.2
Netflix, Inc.	3.63%	05/15/2027		1,970	2,101,061	0.6
Netflix, Inc.	3.63%	06/15/2030		596	616,074	0.2
Summer BC Holdco A SARL	9.25%	10/31/2027		1,658	1,243,104	0.4
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026		1,697	1,589,206	0.4
Summer BidCo BV(b)	9.00%	11/15/2025		770	723,064	0.2
UPC Holding BV	3.88%	06/15/2029		1,000	930,909	0.3
UPCB Finance IV Ltd.	4.00%	01/15/2027		819	822,604	0.2
Virgin Media Finance PLC	5.13%	02/15/2022	GBP	150	162,755	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027		2,370	2,664,917	0.8
Ziggo Bond Co. BV	3.38%	02/28/2030	EUR	3,150	2,992,601	0.9
Ziggo BV	2.88%	01/15/2030		515	506,327	0.1
					18,960,741	5.4
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Altice France Holding SA	4.00%	02/15/2028		1,135	1,019,921	0.3
Altice France Holding SA	8.00%	05/15/2027		4,125	4,384,214	1.3
Altice France SA/France	3.38%	01/15/2028		208	200,658	0.1
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027		4,460	4,746,009	1.4
eircom Finance DAC	1.75%	11/01/2024		389	380,519	0.1
eircom Finance DAC	2.63%	02/15/2027		1,586	1,552,855	0.4
Matterhorn Telecom SA	4.00%	11/15/2027		2,670	2,679,401	0.8
SES SA(a)	5.63%	01/29/2024		1,254	1,257,515	0.4
SoftBank Group Corp.	3.13%	09/19/2025		2,000	1,959,049	0.6
Telecom Italia SpA/Milano	2.38%	10/12/2027		1,970	1,902,161	0.5
Telecom Italia SpA/Milano	2.75%	04/15/2025		1,515	1,515,066	0.4
Telecom Italia SpA/Milano	4.00%	04/11/2024		1,749	1,827,596	0.5
Telecom Italia SpA/Milano, Series E	3.63%	01/19/2024		2,779	2,871,765	0.8
Telecom Italia SpA/Milano, Series E	3.63%	05/25/2026		222	230,497	0.1
Telefonica Europe BV(a)	2.88%	06/24/2027		2,200	2,094,763	0.6
Telefonica Europe BV(a)	4.38%	12/14/2024		5,900	6,116,543	1.7
Telefonica Europe BV(a)	5.88%	03/31/2024		500	542,605	0.1
United Group BV	3.13%	02/15/2026		2,689	2,551,671	0.7
United Group BV	3.63%	02/15/2028		1,354	1,270,764	0.4
					39,103,572	11.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (EUR)	Nettover-mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Adient Global Holdings Ltd.	3.50%	08/15/2024	EUR	1,345	€ 1,169,359	0.3%
Adler Pelzer Holding GmbH	4.13%	04/01/2024		790	379,200	0.1
Faurecia SE	2.38%	06/15/2027		900	833,715	0.2
Faurecia SE	3.13%	06/15/2026		1,394	1,359,054	0.4
Ford Motor Credit Co. LLC	1.74%	07/19/2024		2,600	2,315,080	0.7
Ford Motor Credit Co. LLC	2.39%	02/17/2026		1,400	1,230,145	0.3
Ford Motor Credit Co. LLC	3.02%	03/06/2024		2,115	2,004,568	0.6
Garrett LX I SARL/Garrett Borrowing LLC	5.13%	10/15/2026		2,336	1,544,626	0.4
Gestamp Automocion SA.	3.25%	04/30/2026		1,380	1,251,176	0.4
Gestamp Funding Luxembourg SA	3.50%	05/15/2023		860	822,297	0.2
Grupo Antolin-Irausa SA	3.25%	04/30/2024		1,440	1,212,419	0.3
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.63%	05/15/2025		1,841	1,797,739	0.5
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.75%	09/15/2026		5,747	5,458,648	1.6
Jaguar Land Rover Automotive PLC	4.50%	01/15/2026		571	426,313	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024		816	625,597	0.2
Jaguar Land Rover Automotive PLC	6.88%	11/15/2026		860	665,546	0.2
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	4.38%	05/15/2026		2,596	2,519,529	0.7
Piaggio & C SpA	3.63%	04/30/2025		690	660,771	0.2
Renault SA	1.13%	10/04/2027		600	510,879	0.1
Renault SA	1.25%	06/24/2025		2,900	2,637,243	0.8
Superior Industries International, Inc.	6.00%	06/15/2025		520	324,852	0.1
Tenneco, Inc.	4.88%	04/15/2022		1,525	1,258,283	0.4
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2024		1,219	949,935	0.3
Volvo Car AB, Series E	2.00%	01/24/2025		2,460	2,343,065	0.7
					34,300,039	9.8
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG						
Dometic Group AB	3.00%	05/08/2026		1,100	995,374	0.3
Explorer II AS	3.38%	02/24/2025		624	484,299	0.1
Motion Bondco DAC	4.50%	11/15/2027		3,500	3,022,494	0.9
					4,502,167	1.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Accor SA(a)	2.63%	01/30/2025		300	253,975	0.1
Accor SA(a)	4.38%	01/30/2024		1,200	1,121,436	0.3
Cirsa Finance International SARL	4.75%	05/22/2025		860	760,388	0.2
Codere Finance 2 Luxembourg SA	6.75%	11/01/2021		1,000	473,375	0.2
Ferrovial Netherlands BV(a)	2.12%	02/14/2023		1,170	1,065,127	0.3
International Game Technology PLC	2.38%	04/15/2028		767	672,509	0.2
International Game Technology PLC	3.50%	07/15/2024		1,947	1,821,524	0.5
International Game Technology PLC	3.50%	06/15/2026		828	753,981	0.2
Samsonite Finco SARL	3.50%	05/15/2026		572	455,123	0.1
Scientific Games International, Inc.	3.38%	02/15/2026		1,860	1,614,530	0.5
Wienerberger AG	2.75%	06/04/2025		700	696,114	0.2
					9,688,082	2.8
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
Dufry One BV	2.00%	02/15/2027		3,953	3,234,159	0.9
Dufry One BV	2.50%	10/15/2024		376	325,240	0.1
eG Global Finance PLC	4.38%	02/07/2025		2,200	2,076,446	0.6
Kirk Beauty One GmbH	8.75%	07/15/2023		1,180	550,273	0.2
					6,186,118	1.8
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Casino Guichard Perrachon SA	4.05%	08/05/2026		1,100	910,912	0.3
Casino Guichard Perrachon SA	4.50%	03/07/2024		1,000	873,756	0.2
Casino Guichard Perrachon SA	4.56%	01/25/2023		1,200	1,133,796	0.3
Catalent Pharma Solutions, Inc.	2.38%	03/01/2028		1,746	1,654,428	0.5
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027		977	961,857	0.3
Constantin Investissement 3 SASU	5.38%	04/15/2025		1,331	1,293,288	0.4
International Design Group SpA	6.50%	11/15/2025		223	198,677	0.1
IQVIA, Inc.	2.25%	01/15/2028		1,062	1,027,418	0.3
IQVIA, Inc.	3.25%	03/15/2025		2,911	2,947,259	0.8
Nidda BondCo GmbH	5.00%	09/30/2025		1,390	1,371,912	0.4
Nidda Healthcare Holding GmbH	3.50%	09/30/2024		3,174	3,140,246	0.9
Rossini SARL	6.75%	10/30/2025		490	524,958	0.1
Spectrum Brands, Inc.	4.00%	10/01/2026		1,461	1,374,175	0.4
Sunshine Mid BV	6.50%	05/15/2026		1,463	1,442,692	0.4
Tereos Finance Groupe I SA	4.13%	06/16/2023		1,400	1,002,758	0.3
					19,858,132	5.7
ENERGIE						
Repsol International Finance BV	4.50%	03/25/2075		1,253	1,306,252	0.4
Saipem Finance International BV	2.63%	01/07/2025		1,620	1,579,165	0.4
Trafigura Group Pte Ltd.(a)	7.50%	07/31/2024		261	232,290	0.1
					3,117,707	0.9

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover-mögen %
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
Belden, Inc.	3.88%	03/15/2028	EUR	1,714	€ 1,658,548	0.5%
Belden, Inc.	4.13%	10/15/2026		1,900	1,843,754	0.5
ProGroup AG	3.00%	03/31/2026		2,707	2,561,060	0.7
Rexel SA	2.13%	06/15/2025		563	552,766	0.2
Rexel SA	2.75%	06/15/2026		800	790,899	0.2
SPIE SA	2.63%	06/18/2026		1,800	1,728,348	0.5
Stena International SA	3.75%	02/01/2025		977	857,666	0.2
Travis Perkins PLC	4.50%	09/07/2023	GBP	2,250	2,394,213	0.7
					12,387,254	3.5
DIENSTLEISTUNGEN						
Arena Luxembourg Finance SARL	1.88%	02/01/2028	EUR	2,318	2,101,890	0.6
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023		864	706,864	0.2
Elis SA	1.63%	04/03/2028		2,000	1,778,965	0.5
La Financiere Atalian SASU	4.00%	05/15/2024		1,000	572,014	0.2
La Financiere Atalian SASU	5.13%	05/15/2025		665	380,913	0.1
Q-Park Holding I BV	2.00%	03/01/2027		1,280	1,210,193	0.3
Refinitiv US Holdings, Inc.	4.50%	05/15/2026		1,050	1,102,500	0.3
Refinitiv US Holdings, Inc.	6.88%	11/15/2026		830	890,536	0.3
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH	6.00%	07/30/2026		857	867,578	0.3
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH	2.00%	07/15/2025		1,816	1,754,112	0.5
					11,365,565	3.3
TECHNOLOGIE						
Banff Merger Sub, Inc.	8.38%	09/01/2026		655	612,425	0.2
Boxer Parent Co., Inc.	6.50%	10/02/2025		411	422,110	0.1
Playtech PLC	3.75%	10/12/2023		1,528	1,507,034	0.4
Playtech PLC	4.25%	03/07/2026		518	503,946	0.2
					3,045,515	0.9
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Algeco Global Finance PLC	6.50%	02/15/2023		2,450	2,314,895	0.7
Atlantia SpA	1.63%	02/03/2025		1,480	1,411,427	0.4
Atlantia SpA	1.88%	07/13/2027		938	891,947	0.3
Autostrade per l'Italia SpA	1.75%	06/26/2026		1,775	1,652,805	0.5
Autostrade per l'Italia SpA	1.88%	11/04/2025		1,250	1,181,061	0.3
Autostrade per l'Italia SpA	4.38%	09/16/2025		638	681,066	0.2
Avis Budget Finance PLC	4.13%	11/15/2024		444	337,440	0.1
Avis Budget Finance PLC	4.50%	05/15/2025		374	274,963	0.1
Avis Budget Finance PLC	4.75%	01/30/2026		1,852	1,320,634	0.4
CMA CGM SA	5.25%	01/15/2025		2,080	1,480,275	0.4
CMA CGM SA	6.50%	07/15/2022		580	477,523	0.1
CMA CGM SA	7.75%	01/15/2021		920	884,605	0.3
Europcar Mobility Group	4.00%	04/30/2026		3,141	1,882,608	0.5
Europcar Mobility Group	4.13%	11/15/2024		5,138	3,302,220	0.9
Heathrow Finance PLC	3.88%	03/01/2027	GBP	3,199	3,167,365	0.9
Heathrow Finance PLC	4.13%	09/01/2029		688	667,934	0.2
Kapla Holding SAS	3.38%	12/15/2026	EUR	311	272,160	0.1
Loxam SAS	2.88%	04/15/2026		653	574,751	0.2
Loxam SAS	3.25%	01/14/2025		2,785	2,542,624	0.7
Loxam SAS	3.75%	07/15/2026		1,951	1,794,912	0.5
Loxam SAS	5.75%	07/15/2027		424	338,198	0.1
Loxam SAS	6.00%	04/15/2025		3,607	2,954,319	0.8
Rubis Terminal Infra SAS	5.63%	05/15/2025		659	677,190	0.2
					31,082,922	8.9
					239,484,397	68.7
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	5.38%	01/18/2028		2,320	1,857,188	0.5
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	8.00%	01/22/2030		1,000	891,504	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(a)	5.88%	09/24/2023		600	576,680	0.2
Banco BPM SpA	4.38%	09/21/2027		830	776,898	0.2
Banco de Credito Social Cooperativo SA	7.75%	06/07/2027		400	311,329	0.1
Banco Santander SA(a)	4.38%	01/14/2026		400	351,216	0.1
Bankia SA	3.75%	02/15/2029		3,100	2,998,233	0.9
CaixaBank SA(a)	6.75%	06/13/2024		2,400	2,365,330	0.7
Credit Suisse Group AG(a)	5.10%	01/24/2030	USD	1,299	1,085,034	0.3
Credit Suisse Group AG(a)	6.38%	08/21/2026		1,364	1,253,329	0.3
Credit Suisse Group AG(a)	7.50%	07/17/2023		462	429,024	0.1
Deutsche Bank AG	4.50%	05/19/2026	EUR	2,700	2,688,699	0.8
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	USD	2,191	1,975,989	0.6
Intesa Sanpaolo SpA, Series E	6.63%	09/13/2023	EUR	880	982,814	0.3
Unione di Banche Italiane SpA	5.88%	03/04/2029		770	811,726	0.2
					19,354,993	5.5

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (EUR)	Nettover-mögen %
FINANZEN							
	Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR	2,909	€ 2,644,356	0.7%
VERSICHERUNGEN							
	ASR Nederland NV(a)	4.63%	10/19/2027		2,362	2,262,083	0.7
	Guardian Life Insurance Co. of America (The)	4.85%	01/24/2077	USD	13	14,089	0.0
	Intesa Sanpaolo Vita SpA(a)	4.75%	12/17/2024	EUR	1,100	1,136,450	0.3
	Societa Cattolica di Assicurazioni SC	4.25%	12/14/2047		1,100	1,053,670	0.3
	Unipol Gruppo SpA	3.50%	11/29/2027		1,900	1,912,673	0.6
	UnipolSai Assicurazioni SpA	3.88%	03/01/2028		1,190	1,169,597	0.3
						7,548,562	2.2
SONSTIGE FINANZWERTE							
	Intrum AB	3.00%	09/15/2027		3,100	2,548,154	0.7
	Intrum AB	3.13%	07/15/2024		3,130	2,749,691	0.8
	Intrum AB	3.50%	07/15/2026		4,838	4,141,096	1.2
	LHC3 PLC(b)	4.13%	08/15/2024		3,063	3,041,011	0.9
	Motion Finco SARL	7.00%	05/15/2025		1,030	1,069,478	0.3
						13,549,430	3.9
REITS							
	ADLER Real Estate AG	3.00%	04/27/2026		2,500	2,444,062	0.7
	DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG	1.88%	10/15/2024		900	823,062	0.2
	Fastighets AB Balder	3.00%	03/07/2078		1,017	941,262	0.3
	Iron Mountain UK PLC	3.88%	11/15/2025	GBP	1,000	1,046,008	0.3
	Peach Property Finance GmbH	3.50%	02/15/2023	EUR	1,745	1,703,820	0.5
						6,958,214	2.0
						50,055,555	14.3
						289,539,952	83.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT							
FINANZINSTITUTE							
BANKWESEN							
	Cooperatieve Rabobank UA(a)	3.25%	12/29/2026		1,200	1,115,885	0.3
	Credit Agricole SA(a)	8.13%	12/23/2025	USD	1,865	1,927,920	0.5
	Erste Group Bank AG(a)	5.13%	10/15/2025	EUR	600	579,897	0.2
	Erste Group Bank AG(a)	6.50%	04/15/2024		400	415,230	0.1
	ING Groep NV(a)	5.75%	11/16/2026	USD	2,000	1,754,425	0.5
	KBC Group NV(a)	4.25%	10/24/2025	EUR	1,200	1,148,707	0.3
	Nordea Bank Abp(a)	6.63%	03/26/2026	USD	2,035	1,950,967	0.6
	Svenska Handelsbanken AB(a)	6.25%	03/01/2024		800	749,616	0.2
	Swedbank AB, Series NC5(a)	5.63%	09/17/2024		600	536,685	0.2
	UBS Group AG(a)	7.00%	01/31/2024		1,340	1,247,294	0.4
	UniCredit SpA	4.88%	02/20/2029	EUR	2,110	2,133,222	0.6
	UniCredit SpA(a)	7.50%	06/03/2026		1,350	1,391,330	0.4
						14,951,178	4.3
VERSICHERUNGEN							
	Assicurazioni Generali SpA, Series E	5.50%	10/27/2047		1,602	1,794,847	0.5
	Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059		2,277	2,157,944	0.7
						3,952,791	1.2
						18,903,969	5.5
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
	INEOS Finance PLC	2.88%	05/01/2026		1,045	1,013,996	0.3
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION							
	AT&T, Inc., Series B(a)	2.88%	03/02/2025		600	564,916	0.2
	PPF Telecom Group BV	3.50%	05/20/2024		1,200	1,230,356	0.3
						1,795,272	0.5
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ							
	Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.88%	05/19/2023		1,083	1,110,475	0.3
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER							
	Kraft Heinz Foods Co.	2.25%	05/25/2028		2,054	2,019,969	0.6
	Tesco PLC, Series E	5.13%	04/10/2047		767	1,079,348	0.3
						3,099,317	0.9
						7,019,060	2.0
VERSORGUNGSBETRIEBE							
ELEKTRIZITÄT							
	Naturgy Finance BV(a)	3.38%	04/24/2024		1,100	1,100,767	0.3
						27,023,796	7.8
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN							
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS							
	AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT				109,619	10,014,338	2.9

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (EUR)	Nettovermögen %
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
RCS & RDS SA	3.25%	02/05/2028	EUR	500	€ 480,781	0.1%
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Sazka Group AS	3.88%	02/15/2027		908	762,075	0.2
Sazka Group AS	4.13%	11/20/2024		1,643	1,463,552	0.4
					2,225,627	0.6
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	1.13%	10/15/2024		1,055	942,400	0.3
					3,648,808	1.0
					330,226,894	94.7
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
STAMMAKTIEN						
STAMMAKTIEN						
BIS Industries Holdings Ltd. (c)				175,243	0	0.0
K201640219 (South Africa) Ltd. A Shares (c)				3,574,808	3	0.0
K201640219 (South Africa) Ltd. B Shares (c)				564,959	1	0.0
					4	0.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Banco Espirito Santo SA(d)	4.75%	01/15/2018		600	153,264	0.1
Banco Espirito Santo SA(d)	4.00%	01/21/2019		300	75,958	0.0
					229,222	0.1
REITS						
Consus Real Estate AG	9.63%	05/15/2024		700	712,115	0.2
					941,337	0.3
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Ashland Services BV	2.00%	01/30/2028		800	746,768	0.2
CeramTec BondCo GmbH	5.25%	12/15/2025		790	724,232	0.2
Diamond BC BV	5.63%	08/15/2025		1,070	963,355	0.3
Kleopatra Holdings 1 SCA(b) (c)	9.25%	06/30/2023		985	478,358	0.1
KME SE	6.75%	02/01/2023		1,405	626,915	0.2
Nyrstar Holdings PLC	0.00%	07/31/2026	USD	250	118,937	0.0
Schoeller Packaging BV	6.38%	11/01/2024	EUR	1,300	1,204,699	0.4
					4,863,264	1.4
INVESTITIONSGÜTER						
Ellaktor Value PLC	6.38%	12/15/2024		922	694,667	0.2
Sarens Finance Co. NV	5.75%	02/21/2027		571	405,686	0.1
					1,100,353	0.3
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Banijay Group SAS	6.50%	03/01/2026		306	272,759	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Kongsberg Actuation Systems BV	5.00%	07/15/2025		580	363,609	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Safari Verwaltungs GmbH	5.38%	11/30/2022		740	608,010	0.2
Scientific Games International, Inc.	5.50%	02/15/2026		570	410,554	0.1
					1,018,564	0.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
Maxeda DIY Holding BV	6.13%	07/15/2022		630	443,437	0.1
Takko Luxembourg 2 SCA	5.38%	11/15/2023		600	176,063	0.1
					619,500	0.2
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Picard Bondco SA	5.50%	11/30/2024		570	551,777	0.2
Sigma Holdco BV	5.75%	05/15/2026		829	814,904	0.2
					1,366,681	0.4
ENERGIE						
UGI International LLC	3.25%	11/01/2025		721	682,281	0.2
DIENSTLEISTUNGEN						
Q-Park Holding I BV	1.50%	03/01/2025		567	538,618	0.1
					10,825,629	3.1
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
ContourGlobal Power Holdings SA	4.13%	08/01/2025		790	795,652	0.2
					12,562,618	3.6

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover-mögen %
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
K2016470260 (South Africa) Ltd. (b)			EUR	120,268	€ 96	0.0%
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN						
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN						
SNS Bank NV Series E (a) (c)				200,000	0	0.0
SNS Reaal NV (a) (c)				260,000	0	0.0
					0	0.0
					12,562,718	3.6
Gesamtanlagen						
(Kosten €373,723,021)					€342,789,612	98.3%
Termineinlagen						
BBH, Grand Cayman(e)	0.01 %	–			18	0.0
Sumitomo, Tokyo(e)	(0.67)%	–			1,277,617	0.4
Sumitomo, Tokyo(e)	0.01 %	–			53,177	0.0
Sumitomo, London(e)	0.01 %	–			120,502	0.0
Termineinlagen insgesamt					1,451,314	0.4
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					4,572,475	1.3
Nettovermögen					€348,813,401	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Short					
Euro-BOBL Futures	06/08/2020	10	€ 1,362,770	€ 1,351,500	€ 11,270
Euro-Bund Futures	06/08/2020	78	13,628,960	13,451,880	177,080
Long Gilt Futures	09/28/2020	41	6,266,141	6,269,334	(3,193)
U.S. 10 Yr Ultra Futures	09/21/2020	45	6,346,237	6,377,880	(31,643)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	19	2,147,567	2,150,241	(2,674)
					€ 150,840
				Wertsteigerung	€ 188,350
				Wertminderung	€ (37,510)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	USD	1,270	EUR	1,158	06/10/2020	€ 14,618
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	196	USD	214	06/10/2020	(3,261)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	211	AUD	354	06/12/2020	837
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	19	CHF	20	06/12/2020	(262)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	9	GBP	8	06/12/2020	(188)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	5	HKD	44	06/12/2020	(122)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	10	SGD	15	06/12/2020	(211)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	10,652	USD	11,553	06/12/2020	(246,163)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	5	CNH	40	06/22/2020	(110)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	5	CNH	42	06/30/2020	(72)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	5	HKD	47	06/30/2020	(46)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	8	PLN	37	06/30/2020	(19)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	10	SGD	15	06/30/2020	(47)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	23,398	EUR	21,612	06/10/2020	537,047
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	10,377	EUR	11,747	07/17/2020	210,126
Societe Generale	USD	1,225	EUR	1,130	06/10/2020	26,380
						€ 538,507
					Wertsteigerung	€ 789,008
					Wertminderung	€ (250,501)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 32, 5 Year Index	12/20/2024	EUR 10,550	€ (387,536)	€ 74,775
Verkaufskontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 32, 5 Year Index	12/20/2024	10,550	387,536	(132,842)
Insgesamt				€ 0	€ (58,067)
				Wertsteigerung	€ 74,775
				Wertminderung	€ (132,842)

(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) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

(d) Not leidendes fälliges Wertpapier.

(e) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CHF – Swiss Franc
CNH – Chinese Yuan Renminbi
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
PLN – Polish Zloty
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

BOBL – Bundesobligationen
CBT – Chicago Board of Trade
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
FINANZWERTE			
BANKEN			
Associated Banc-Corp.	52,290	$ 732,583	1.4%
Comerica, Inc.	14,641	532,200	1.0
Sterling Bancorp/DE	38,577	474,497	0.9
Synovus Financial Corp.	27,293	523,753	1.0
Texas Capital Bancshares, Inc.	10,968	293,504	0.5
Umpqua Holdings Corp.	58,718	668,798	1.2
Webster Financial Corp.	20,311	574,801	1.1
Zions Bancorp NA	20,443	672,677	1.3
		4,472,813	8.4
KAPITALMÄRKTE			
Moelis & Co.	15,718	528,596	1.0
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
OneMain Holdings, Inc.	9,721	226,791	0.4
VERSICHERUNGEN			
American Financial Group, Inc./OH	7,760	467,462	0.9
Everest Re Group Ltd.	3,064	607,928	1.1
First American Financial Corp.	12,444	628,298	1.2
Hanover Insurance Group, Inc. (The)	4,819	483,587	0.9
Kemper Corp.	6,363	403,414	0.8
Reinsurance Group of America, Inc. - Class A	7,196	653,037	1.2
Selective Insurance Group, Inc.	7,317	383,777	0.7
		3,627,503	6.8
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG			
BankUnited, Inc.	33,236	614,201	1.1
Essent Group Ltd.	15,638	516,836	1.0
		1,131,037	2.1
		9,986,740	18.7
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
AAR Corp.	17,054	343,979	0.7
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
Hub Group, Inc. - Class A	1,118	52,289	0.1
XPO Logistics, Inc.	4,330	341,247	0.6
		393,536	0.7
FLUGGESELLSCHAFTEN			
Alaska Air Group, Inc.	14,385	491,823	0.9
SkyWest, Inc.	14,489	464,662	0.9
		956,485	1.8
BAUPRODUKTE			
Masonite International Corp.	14,195	942,264	1.8
BAU- UND INGENIEURWESEN			
AECOM	16,246	629,858	1.2
Quanta Services, Inc.	21,156	781,291	1.5
		1,411,149	2.7
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
EnerSys	10,415	659,269	1.2
Regal Beloit Corp.	10,616	844,397	1.6
		1,503,666	2.8
MASCHINEN			
Kennametal, Inc.	26,839	744,514	1.4
Oshkosh Corp.	9,940	713,891	1.3
		1,458,405	2.7
STRASSE UND SCHIENE			
Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	17,991	748,606	1.4
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
MRC Global, Inc.	68,084	403,057	0.7
United Rentals, Inc.	3,290	456,948	0.9
		860,005	1.6
		8,618,095	16.2
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Dana, Inc.	57,614	728,241	1.4
Lear Corp.	5,515	584,866	1.1
		1,313,107	2.5

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Houghton Mifflin Harcourt Co.	49,169	$ 75,229	0.1%
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Papa John's International, Inc.	12,019	936,160	1.7
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
KB Home	10,810	357,595	0.7
PulteGroup, Inc.	24,550	833,963	1.6
Taylor Morrison Home Corp. - Class A	20,850	403,031	0.7
		1,594,589	3.0
FREIZEITPRODUKTE			
Brunswick Corp./DE	14,108	776,081	1.4
Callaway Golf Co.	47,907	733,935	1.4
		1,510,016	2.8
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Foot Locker, Inc.	17,132	474,556	0.9
Williams-Sonoma, Inc.	13,934	1,159,448	2.2
		1,634,004	3.1
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Capri Holdings Ltd.	13,810	207,702	0.4
Crocs, Inc.	15,245	436,769	0.8
Ralph Lauren Corp.	5,760	434,938	0.8
Skechers U.S.A., Inc. - Class A	13,189	413,080	0.8
		1,492,489	2.8
		8,555,594	16.0
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONSAUSRÜSTUNG			
NetScout Systems, Inc.	19,857	545,472	1.0
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Arrow Electronics, Inc.	5,860	404,809	0.7
Belden, Inc.	16,783	571,293	1.1
TTM Technologies, Inc.	41,487	480,005	0.9
Vishay Intertechnology, Inc.	36,300	590,238	1.1
		2,046,345	3.8
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Amdocs Ltd.	10,899	678,572	1.3
Genpact Ltd.	13,416	482,305	0.9
		1,160,877	2.2
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Kulicke & Soffa Industries, Inc.	31,608	706,755	1.3
MaxLinear, Inc. - Class A	30,548	529,091	1.0
		1,235,846	2.3
SOFTWARE			
CommVault Systems, Inc.	19,497	788,849	1.5
Nuance Communications, Inc.	20,619	471,763	0.9
Verint Systems, Inc.	10,230	474,365	0.9
		1,734,977	3.3
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
NCR Corp.	26,506	478,433	0.9
		7,201,950	13.5
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
American Campus Communities, Inc.	16,713	539,830	1.0
Americold Realty Trust	17,746	633,710	1.2
Camden Property Trust	8,422	771,203	1.4
Cousins Properties, Inc.	17,176	534,517	1.0
CubeSmart	29,349	835,272	1.6
Easterly Government Properties, Inc.	20,124	504,509	0.9
MGM Growth Properties LLC - Class A	26,402	732,127	1.4
Park Hotels & Resorts, Inc.	26,577	261,252	0.5
Physicians Realty Trust	32,588	562,795	1.1
STAG Industrial, Inc.	26,287	707,120	1.3
Sun Communities, Inc.	3,954	542,449	1.0
		6,624,784	12.4
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Primo Water Corp.	55,947	673,042	1.3
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
US Foods Holding Corp.	21,788	417,022	0.8

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Hain Celestial Group, Inc. (The)			28,158	$ 886,414	1.7%
Nomad Foods Ltd.			36,810	779,636	1.4
				1,666,050	3.1
				2,756,114	5.2
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Orion Engineered Carbons SA			42,246	467,241	0.9
Trinseo SA			13,018	267,910	0.5
Westlake Chemical Corp.			7,277	347,113	0.6
				1,082,264	2.0
CONTAINER UND VERPACKUNGEN					
Graphic Packaging Holding Co.			38,180	552,465	1.0
Sealed Air Corp.			22,263	714,642	1.4
				1,267,107	2.4
METALL UND BERGBAU					
Carpenter Technology Corp.			15,846	370,321	0.7
				2,719,692	5.1
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
Alliant Energy Corp.			16,019	790,698	1.5
PNM Resources, Inc.			11,631	474,777	0.9
				1,265,475	2.4
GASVERSORGUNGSBETRIEBE					
Southwest Gas Holdings, Inc.			5,201	395,016	0.7
MEHRFACH-VERSORGUNGSBETRIEBE					
Black Hills Corp.			7,818	482,449	0.9
				2,142,940	4.0
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
Molina Healthcare, Inc.			3,913	727,113	1.4
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN					
ICON PLC			3,182	536,008	1.0
PHARMAZEUTIKA					
Perrigo Co. PLC			9,710	531,817	1.0
				1,794,938	3.4
ENERGIE					
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE					
Dril-Quip, Inc.			13,689	416,009	0.8
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Cimarex Energy Co.			4,769	125,329	0.2
HollyFrontier Corp.			24,627	774,519	1.5
				899,848	1.7
				1,315,857	2.5
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
MEDIEN					
Criteo SA (Sponsored ADR)			27,901	285,985	0.5
Gesamtanlagen					
(Kosten $58,929,043)				$ 52,002,689	97.5%
Termineinlagen					
Barclays, London(a)	0.01 %	–		1,896,744	3.5
BBH, Grand Cayman(a)	(0.67)%	–		517	0.0
Termineinlagen insgesamt				1,897,261	3.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(540,302)	(1.0)
Nettovermögen				$ 53,359,648	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1	AUD	1	06/12/2020	$ 23
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,669	EUR	1,537	06/12/2020	37,496
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	15	SGD	21	06/12/2020	43
						$ 37,562

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
EUR – Euro
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
A-Living Services Co., Ltd. - Class H	1,104,000	$ 5,969,844	0.5%
Abu Dhabi Islamic Bank PJSC	369,670	342,138	0.0
Abu Dhabi National Oil Co. for Distribution PJSC	766,630	603,177	0.1
Adaro Energy Tbk PT	6,459,000	488,183	0.0
Advanced Info Service PCL	89,900	544,035	0.0
Advanced Petrochemical Co.	18,894	249,053	0.0
Agile Group Holdings Ltd.	530,000	550,065	0.0
Agricultural Bank of China Ltd. - Class H	11,265,000	4,571,695	0.4
Aguas Andinas SA - Class A	936,760	275,153	0.0
AIA Group Ltd.	262,600	2,154,838	0.2
Aldar Properties PJSC	9,392,190	4,449,571	0.3
Alibaba Group Holding Ltd. (ADR)	154,752	32,094,017	2.7
America Movil SAB de CV	740,090	491,958	0.0
Anhui Conch Cement Co., Ltd. - Class A	924,253	7,385,126	0.6
Anhui Conch Cement Co., Ltd. - Class H	484,557	3,653,800	0.3
Asia Cement Corp.	3,837,000	5,575,128	0.4
Asian Paints Ltd.	24,202	537,425	0.0
Asustek Computer, Inc.	434,000	3,047,099	0.3
AU Small Finance Bank Ltd.	43,338	227,047	0.0
Banco Macro SA (ADR)	19,050	326,898	0.0
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	574,052	377,964	0.0
Bank of Beijing Co., Ltd. - Class A	801,600	549,361	0.0
Bank of China Ltd. - Class A	1,078,300	522,108	0.0
Bank of China Ltd. - Class H	7,291,000	2,680,040	0.2
Barwa Real Estate Co.	505,260	410,398	0.0
BB Seguridade Participacoes SA	249,000	1,179,604	0.1
Beijing Oriental Yuhong Waterproof Technology Co., Ltd. - Class A	105,200	570,600	0.0
Biocon Ltd.	129,730	610,156	0.1
Bukit Asam Tbk PT	4,352,500	582,497	0.1
C&S Paper Co., Ltd.	1,544,380	4,395,404	0.4
CD Projekt SA	7,000	705,643	0.1
Centrais Eletricas Brasileiras SA	115,600	620,210	0.1
Centrais Eletricas Brasileiras SA (Preference Shares)	587,900	3,382,218	0.3
China Aoyuan Group Ltd.	446,000	478,234	0.0
China CITIC Bank Corp., Ltd. - Class H	29,381,000	12,839,639	1.1
China Communications Services Corp., Ltd. - Class H	3,016,000	2,011,307	0.2
China Conch Venture Holdings Ltd.	127,000	573,198	0.0
China Construction Bank Corp. - Class H	6,604,000	5,208,532	0.4
China Everbright Bank Co., Ltd. - Class H	1,467,000	597,383	0.1
China Everbright Ltd.	5,016,000	7,091,976	0.6
China Galaxy Securities Co., Ltd. - Class H	1,136,500	550,863	0.0
China Lesso Group Holdings Ltd.	439,000	533,714	0.0
China Medical System Holdings Ltd.	2,978,000	3,415,053	0.3
China Merchants Port Holdings Co., Ltd.	452,000	554,300	0.0
China Minsheng Banking Corp., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	490,900	392,284	0.0
China Minsheng Banking Corp., Ltd. - Class H	8,900,100	6,214,125	0.5
China Mobile Ltd.	209,000	1,477,785	0.1
China National Building Material Co., Ltd. - Class H	482,000	546,824	0.0
China Resources Cement Holdings Ltd.	7,962,000	10,059,332	0.9
China Yuchai International Ltd.	193,170	2,387,581	0.2
Chongqing Zhifei Biological Products Co., Ltd. - Class A	51,800	610,723	0.1
Cogna Educacao	9,900	9,758	0.0
Commercial Bank PSQC (The)	503,056	527,768	0.0
Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	133,000	630,155	0.1
CPFL Energia SA	100,900	609,790	0.1
Daelim Industrial Co., Ltd.	46,620	3,488,626	0.3
Daqin Railway Co., Ltd. - Class A	2,167,766	2,074,515	0.2
Dino Polska SA	175,440	8,004,406	0.7
Divi's Laboratories Ltd.	18,870	597,863	0.1
Dubai Islamic Bank PJSC	465,709	448,652	0.0
Eastern Co. SAE	733,825	581,699	0.1
EDP - Energias de Portugal SA	123,691	577,833	0.1
ElSewedy Electric Co.	903,310	436,948	0.0
Empresa De Energia De Bogota	172,464	100,797	0.0
Engie Brasil Energia SA	151,900	1,207,218	0.1
Equatorial Energia SA	631,300	2,371,974	0.2
Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	503,612	593,830	0.1
Exxaro Resources Ltd.	97,226	689,655	0.1
Fibra Uno Administracion SA de CV	4,530,530	3,475,358	0.3
Formosa Chemicals & Fibre Corp.	1,181,000	2,837,488	0.2
Fortescue Metals Group Ltd.	227,890	2,109,673	0.2
Fortress REIT Ltd. - Class A	889,393	562,156	0.0
Fu Shou Yuan International Group Ltd.	2,679,000	2,503,623	0.2
Fubon Financial Holding Co., Ltd.	3,240,000	4,584,985	0.4

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
GAIL India Ltd.	5,193,976	$ 6,296,652	0.5%
GDS Holdings Ltd. (ADR)	123,640	7,047,480	0.6
GF Securities Co., Ltd. - Class H	519,000	533,832	0.0
Glencore PLC	1,723,210	3,254,376	0.3
Globe Telecom, Inc.	13,150	595,967	0.1
GMexico Transportes SAB de CV	141,150	159,135	0.0
Grupo Aeroportuario del Pacifico SAB de CV - Class B	116,550	775,791	0.1
Guangzhou R&F Properties Co., Ltd. - Class H	424,400	527,361	0.0
Gulf Energy Development PCL	551,200	654,128	0.1
Haci Omer Sabanci Holding AS	4,224,686	5,136,732	0.4
Halyk Savings Bank of Kazakhstan JSC (GDR)	206,200	2,175,410	0.2
Hana Financial Group, Inc.	533,743	12,896,140	1.1
Hartalega Holdings Bhd	336,100	971,239	0.1
HCL Technologies Ltd.	64,570	472,758	0.0
HDFC Asset Management Co., Ltd.	15,901	536,146	0.0
Hellenic Telecommunications Organization SA	42,870	600,221	0.1
Henan Shuanghui Investment & Development Co., Ltd. - Class A	101,200	562,201	0.0
Highwealth Construction Corp.	419,000	620,016	0.1
Hindustan Unilever Ltd.	29,965	817,402	0.1
Hisense Home Appliances Group Co., Ltd. - Class A	1,325,591	2,211,179	0.2
Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.	3,475,000	8,791,382	0.7
Hotai Motor Co., Ltd.	33,000	591,889	0.1
Huaxin Cement Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	525,660	1,836,970	0.2
Hyundai Motor Co.	7,280	578,821	0.1
Indraprastha Gas Ltd.	96,052	585,591	0.1
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	403,920	914,656	0.1
Industrial Bank of Korea	308,810	2,074,144	0.2
Infosys Ltd. (Sponsored ADR)	125,840	1,145,144	0.1
Inventec Corp.	739,000	600,971	0.1
Iskenderun Demir ve Celik AS	597,472	621,490	0.1
Itausa - Investimentos Itau SA (Preference Shares)	1	2	0.0
Jafron Biomedical Co., Ltd. - Class A	68,082	602,245	0.1
JD.com, Inc. (ADR)	160,517	8,720,889	0.7
Jiangxi Copper Co., Ltd. - Class H	2,573,000	2,366,121	0.2
Jinke Properties Group Co., Ltd. - Class A	470,600	509,677	0.0
KB Financial Group, Inc.	192,940	5,265,546	0.4
Kia Motors Corp.	30,020	834,752	0.1
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV - Class A	403,867	628,717	0.1
Kingboard Laminates Holdings Ltd.	149,500	132,057	0.0
KT Corp.	110	2,157	0.0
KT Corp. (Sponsored ADR)	342,710	3,337,995	0.3
KT&G Corp.	11,930	809,669	0.1
Kumba Iron Ore Ltd. (a)	112,550	3,039,633	0.3
Kumho Petrochemical Co., Ltd.	29,920	1,721,546	0.1
KWG Group Holdings Ltd.	378,500	531,466	0.0
Li Ning Co., Ltd.	249,000	843,548	0.1
Livzon Pharmaceutical Group, Inc. - Class A (Nth SZ-SEHK)	99,394	555,219	0.0
Logan Property Holdings Co., Ltd.	330,000	495,969	0.0
Lojas Americanas SA	161,500	708,793	0.1
LUKOIL PJSC (Sponsored ADR)	218,503	16,451,091	1.4
Maanshan Iron & Steel Co., Ltd. - Class H (a)	844,000	242,919	0.0
Magnit PJSC (Sponsored GDR)	55,960	637,944	0.1
Malayan Banking Bhd	314,800	543,862	0.0
Manila Electric Co.	16,590	92,921	0.0
Masraf Al Rayan QSC	578,320	629,321	0.1
MCB Bank Ltd.	300,352	279,511	0.0
MediaTek, Inc.	331,000	5,110,490	0.4
Midea Real Estate Holding Ltd.	165,000	389,284	0.0
Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	107,200	1,602,224	0.1
Momentum Metropolitan Holdings	383,842	376,894	0.0
Momo, Inc. (Sponsored ADR)	108,620	2,107,228	0.2
Moneta Money Bank AS	993,886	2,210,345	0.2
MTN Group Ltd.	65,854	204,143	0.0
Muthoot Finance Ltd.	105,056	1,198,822	0.1
Muyuan Foodstuff Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	32,500	549,298	0.0
Nanjing King-Friend Biochemical Pharmaceutical Co., Ltd. - Class A	71,660	628,755	0.1
Naspers Ltd. - Class N	2,082	338,935	0.0
NCSoft Corp.	9,840	6,285,612	0.5
Nestle India Ltd.	2,661	619,080	0.1
NetEase, Inc. (ADR)	6,570	2,515,653	0.2
New Oriental Education & Technology Group, Inc. (Sponsored ADR)	83,677	10,037,893	0.9
Nine Dragons Paper Holdings Ltd.	596,000	524,060	0.0
Novatek Microelectronics Corp.	486,000	3,327,673	0.3
NWS Holdings Ltd.	567,655	447,742	0.0
Oil & Gas Development Co., Ltd.	935,319	663,238	0.1
Old Mutual Ltd.	259,930	166,789	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
OPAP SA	534,104	$ 4,989,686	0.5%
Pegatron Corp.	273,000	587,596	0.1
Petroleo Brasileiro SA (Preference Shares)	902,700	3,440,758	0.3
Petronas Gas Bhd	83,400	365,034	0.0
Petronet LNG Ltd.	340,468	1,152,938	0.1
Philip Morris International, Inc.	15,010	1,101,134	0.1
Phison Electronics Corp.	58,000	534,580	0.0
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	395,000	3,908,971	0.3
PLDT, Inc.	25,065	623,806	0.1
Polyus PJSC (GDR)	14,147	1,170,797	0.1
POSCO	53,990	7,943,107	0.7
Postal Savings Bank of China Co., Ltd.	966,000	618,719	0.1
Powerlong Real Estate Holdings Ltd.	2,788,000	1,557,696	0.1
Powertech Technology, Inc.	190,000	615,343	0.1
Powszechny Zaklad Ubezpieczen SA	75,666	563,783	0.0
Qatar International Islamic Bank QSC	70,880	152,355	0.0
Qatar Islamic Bank SAQ	128,590	551,962	0.0
QL Resources Bhd	171,500	398,841	0.0
Quanta Computer, Inc.	273,000	637,731	0.1
REC Ltd.	2,671,720	3,144,475	0.3
Refrigeration Electrical Engineering Corp.	1,391,403	1,872,023	0.2
Resilient REIT Ltd.	7,738	16,422	0.0
Richter Gedeon Nyrt	113,880	2,488,902	0.3
Ruentex Industries Ltd.	1,392,000	3,032,323	0.3
Samsung Biologics Co., Ltd.	1,300	655,465	0.1
Samsung Card Co., Ltd.	97,043	2,320,907	0.2
Samsung Electronics Co., Ltd.	646,974	26,646,324	2.3
Samsung Electronics Co., Ltd. (Preference Shares)	390,452	13,594,091	1.1
Samsung Securities Co., Ltd.	24,916	565,634	0.0
Sberbank of Russia PJSC (Sponsored ADR)	655,133	7,494,722	0.6
Shennan Circuits Co., Ltd. - Class A	222,467	4,750,438	0.4
Shenzhen Kangtai Biological Products Co., Ltd. - Class A	31,530	647,200	0.1
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd.	16,030	626,852	0.1
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	54,841	1,340,416	0.1
Shui On Land Ltd.	3,114,000	516,593	0.0
Silergy Corp.	11,000	595,455	0.1
Simplo Technology Co., Ltd.	25,000	267,842	0.0
Sinotruk Hong Kong Ltd.	2,963,000	7,222,295	0.6
SK Telecom Co., Ltd.	1,310	228,794	0.0
Standard Foods Corp.	202,000	427,468	0.0
Sun Art Retail Group Ltd. 1 Month HIBOR	365,000	561,838	0.0
Sunny Friend Environmental Technology Co., Ltd.	363,000	3,147,298	0.3
Surgutneftegas PJSC (Sponsored ADR) (a)	777,734	4,360,910	0.4
Taiwan Cement Corp.	1,897,187	2,693,440	0.2
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	1,966,000	19,112,026	1.7
TAL Education Group (ADR)	42,150	2,379,789	0.2
Tangshan Jidong Cement Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	205,559	502,092	0.0
TCS Group Holding PLC (GDR)	238,800	4,158,800	0.4
Tencent Holdings Ltd.	490,200	26,547,207	2.3
Times China Holdings Ltd.	656,000	971,133	0.1
Top Glove Corp. Bhd	374,800	1,148,944	0.1
Tosoh Corp.	413,400	5,764,813	0.5
Tripod Technology Corp.	1,001,000	3,764,164	0.3
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	396,313	3,515,600	0.3
Turkiye Is Bankasi AS - Class C	4,120,850	2,987,873	0.3
Unilever PLC	140,390	7,538,046	0.6
United Microelectronics Corp.	1,083,000	559,005	0.0
Vedanta Ltd.	4,370,869	5,322,706	0.5
Vipshop Holdings Ltd. (ADR)	34,960	606,206	0.1
Vodacom Group Ltd. (a)	85,732	616,565	0.1
Walsin Technology Corp.	37,000	231,241	0.0
Want Want China Holdings Ltd.	795,000	576,486	0.1
WEG SA	76,700	601,233	0.1
Weichai Power Co., Ltd. - Class H	330,000	571,670	0.0
WH Group Ltd.	1,157,000	1,006,526	0.1
Wistron Corp.	3,384,000	3,226,256	0.3
Woori Financial Group, Inc.	147,210	1,086,290	0.1
Wuliangye Yibin Co., Ltd. - Class A	366,325	7,633,152	0.7
Yageo Corp.	109,000	1,352,674	0.1
Yandex NV - Class A	87,610	3,524,550	0.3
Yealink Network Technology Corp. Ltd. - Class A	5,800	73,535	0.0
Yuexiu Property Co., Ltd.	2,080,000	375,564	0.0
Yuzhou Properties Co., Ltd.	1,326,000	546,775	0.0
Zai Lab Ltd. (ADR)	9,720	723,168	0.1
Zhejiang Expressway Co., Ltd. - Class H	1,434,000	1,010,170	0.1
Zhejiang NHU Co., Ltd. - Class A	143,000	508,809	0.0

		Zinssatz	Datum		Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
	Zhen Ding Technology Holding Ltd.				821,000	$ 3,281,181	0.3%
	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. - Class A				4,614,545	4,127,675	0.4
	Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. - Class H				3,240,600	2,666,491	0.2
						577,314,407	49.2
STAATSANLEIHEN							
	Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	09/30/2049	USD	5,061	5,087,887	0.4
	Abu Dhabi Government International Bond	3.88%	04/16/2050		2,795	3,182,806	0.3
	Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029		3,101	1,916,806	0.2
	Angolan Government International Bond	8.25%	05/09/2028		4,029	2,484,130	0.2
	Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049		5,512	3,298,587	0.3
	Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048		1,793	1,068,516	0.1
	Argentine Republic Government International Bond(b)	3.88%	01/15/2022	EUR	398	165,537	0.0
	Argentine Republic Government International Bond(b)	5.63%	01/26/2022	USD	1,083	427,785	0.0
	Argentine Republic Government International Bond(b)	6.88%	04/22/2021		434	176,177	0.0
	Argentine Republic Government International Bond(b)	6.88%	01/26/2027		22,990	8,333,875	0.7
	Argentine Republic Government International Bond(b)	6.88%	01/11/2048		9,315	3,301,003	0.3
	Argentine Republic Government International Bond(b)	7.13%	06/28/2117		796	281,336	0.0
	Argentine Republic Government International Bond(b)	7.50%	04/22/2026		9,418	3,561,181	0.3
	Argentine Republic Government International Bond(b)	7.82%	12/31/2033	EUR	857	401,894	0.0
	Argentine Republic Government International Bond, Series NY(b)	3.75%	12/31/2038	USD	1,988	752,334	0.1
	Argentine Republic Government International Bond, Series NY(b)	8.28%	12/31/2033		3,616	1,656,514	0.1
	Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031		1,846	1,741,009	0.2
	Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044		3,923	3,523,344	0.3
	Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029		3,184	3,255,640	0.3
	Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028		6,081	6,347,044	0.5
	Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030		400	422,000	0.0
	Bermuda Government International Bond	4.75%	02/15/2029		4,219	4,698,911	0.4
	CBB International Sukuk Programme Co. SPC	4.50%	03/30/2027		1,201	1,188,990	0.1
	Colombia Government International Bond	5.00%	06/15/2045		4,046	4,592,210	0.4
	Costa Rica Government International Bond	7.00%	04/04/2044		1,341	1,036,342	0.1
	Dominican Republic International Bond	5.50%	01/27/2025		299	297,879	0.0
	Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060		1,335	1,130,161	0.1
	Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028		2,053	1,977,296	0.2
	Dominican Republic International Bond	6.40%	06/05/2049		2,320	2,079,300	0.2
	Dominican Republic International Bond	6.50%	02/15/2048		5,098	4,604,131	0.4
	Dominican Republic International Bond	6.85%	01/27/2045		1,413	1,325,571	0.1
	Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026		1,038	1,067,518	0.1
	Dominican Republic International Bond	7.45%	04/30/2044		1,090	1,072,628	0.1
	Ecuador Government International Bond(b)	7.78%	01/23/2028		9,054	3,196,062	0.2
	Ecuador Government International Bond(b)	7.88%	03/27/2025		1,017	381,884	0.0
	Ecuador Government International Bond(b)	8.88%	10/23/2027		7,094	2,568,028	0.2
	Ecuador Government International Bond(b)	9.50%	03/27/2030		1,601	581,964	0.1
	Ecuador Government International Bond(b)	9.63%	06/02/2027		731	267,912	0.0
	Ecuador Government International Bond(b)	9.65%	12/13/2026		1,828	680,016	0.1
	Ecuador Government International Bond(b)	10.65%	01/31/2029		2,059	739,181	0.1
	Ecuador Government International Bond(b)	10.75%	03/28/2022		2,124	936,684	0.1
	Egypt Government International Bond	5.63%	04/16/2030	EUR	1,602	1,582,687	0.1
	Egypt Government International Bond	5.88%	06/11/2025	USD	2,532	2,531,209	0.2
	Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048		2,061	1,903,205	0.2
	Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047		2,498	2,426,963	0.2
	Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049		2,975	2,907,133	0.3
	Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050		2,265	2,236,687	0.2
	El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025		1,398	1,141,554	0.1
	El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027		684	559,170	0.1
	El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050		3,625	2,776,524	0.2
	El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035		722	576,246	0.1
	El Salvador Government International Bond	7.75%	01/24/2023		1,100	985,187	0.1
	Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031		3,663	3,052,882	0.3
	Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025		2,616	2,311,890	0.2
	Ghana Government International Bond	7.88%	02/11/2035		2,728	2,337,555	0.2
	Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032		1,010	885,959	0.1
	Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049		1,864	1,611,195	0.1
	Ghana Government International Bond	8.75%	03/11/2061		384	331,560	0.0
	Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051		2,059	1,789,400	0.2
	Guatemala Government Bond	4.38%	06/05/2027		2,488	2,547,867	0.2
	Guatemala Government Bond	4.50%	05/03/2026		200	205,125	0.0
	Guatemala Government Bond	6.13%	06/01/2050		3,156	3,559,376	0.3
	Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027		2,579	2,690,219	0.2
	Honduras Government International Bond	7.50%	03/15/2024		3,788	4,006,994	0.3
	Indonesia Government International Bond	3.70%	10/30/2049		2,000	2,055,178	0.2
	Indonesia Government International Bond	4.13%	01/15/2025		4,470	4,822,021	0.4
	Israel Government International Bond	3.88%	07/03/2050		1,468	1,681,230	0.1
	Israel Government International Bond	4.50%	04/03/2120		1,542	1,880,321	0.2
	Ivory Coast Government International Bond	5.38%	07/23/2024		1,064	1,015,122	0.1

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
Ivory Coast Government International Bond	5.88%	10/17/2031	EUR	3,750	$	3,782,842	0.3%
Ivory Coast Government International Bond	6.63%	03/22/2048		1,084		1,055,060	0.1
Jamaica Government International Bond	6.75%	04/28/2028	USD	3,195		3,357,745	0.3
Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045		3,050		3,368,344	0.3
Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028		1,561		1,474,657	0.1
Lebanon Government International Bond(b)	6.00%	01/27/2023		812		142,100	0.0
Lebanon Government International Bond(b)	6.65%	04/22/2024		1,060		182,519	0.0
Lebanon Government International Bond(b)	6.85%	03/23/2027		5,631		971,348	0.1
Lebanon Government International Bond, Series E(b)	6.10%	10/04/2022		1,371		239,925	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(b)	1.00%	11/27/2026		2,053		357,992	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(b)	6.20%	02/26/2025		2,310		398,475	0.0
Mexico Government International Bond	5.00%	04/27/2051		2,045		2,198,375	0.2
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027		394		349,552	0.0
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047		1,585		1,307,625	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038		3,376		2,864,325	0.2
Oman Government International Bond	4.75%	06/15/2026		834		689,093	0.1
Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048		2,413		1,816,537	0.2
Panama Government International Bond	3.16%	01/23/2030		1,700		1,795,094	0.2
Panama Government International Bond	4.50%	04/16/2050		3,219		3,804,456	0.3
Panama Government International Bond	4.50%	04/01/2056		4,343		5,120,397	0.4
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026		1,620		1,666,980	0.1
Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031		1,869		2,012,446	0.2
Paraguay Government International Bond	5.40%	03/30/2050		736		808,680	0.1
Perusahaan Penerbit SBSN Indonesia III	4.15%	03/29/2027		1,370		1,487,734	0.1
Peruvian Government International Bond	2.78%	01/23/2031		5,293		5,568,236	0.5
Peruvian Government International Bond	5.63%	11/18/2050		666		1,039,376	0.1
Philippine Government International Bond	3.70%	02/02/2042		2,542		2,920,917	0.3
Qatar Government International Bond	4.40%	04/16/2050		11,508		13,665,750	1.2
Qatar Government International Bond	4.50%	04/23/2028		2,548		2,946,125	0.3
Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048		3,617		4,730,358	0.4
Republic of South Africa Government International Bond	5.00%	10/12/2046		3,318		2,627,441	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047		4,014		3,271,410	0.3
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049		3,929		3,202,135	0.3
Russian Foreign Bond - Eurobond	5.25%	06/23/2047		10,600		14,296,750	1.2
Russian Foreign Bond - Eurobond	5.63%	04/04/2042		200		273,313	0.0
Russian Foreign Bond - Eurobond	5.88%	09/16/2043		200		285,438	0.0
Rwanda International Government Bond	6.63%	05/02/2023		222		211,178	0.0
Saudi Government International Bond	3.25%	10/22/2030		2,173		2,249,055	0.2
Saudi Government International Bond	4.63%	10/04/2047		1,354		1,526,635	0.1
Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049		2,875		3,396,094	0.3
Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050		2,929		3,575,211	0.3
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR	278		282,074	0.0
Senegal Government International Bond	6.25%	07/30/2024	USD	581		578,821	0.1
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048		3,930		3,539,456	0.3
Sri Lanka Government International Bond	6.20%	05/11/2027		5,439		2,962,555	0.3
Sri Lanka Government International Bond	6.83%	07/18/2026		245		133,295	0.0
Sri Lanka Government International Bond	6.85%	11/03/2025		2,925		1,599,609	0.1
Turkey Government International Bond	4.88%	04/16/2043		3,860		2,814,326	0.2
Turkey Government International Bond	5.75%	05/11/2047		3,186		2,492,049	0.2
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032		4,330		4,124,325	0.4
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2023		5,609		5,642,654	0.5
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2024		284		285,136	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026		6,011		5,986,956	0.5
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027		323		319,467	0.0
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2028		300		322,125	0.0
Ukraine Government International Bond, Series GDP(c)	0.00%	05/31/2040		3,550		3,007,516	0.3
Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055		193		235,801	0.0
Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050		1,140		1,397,148	0.1
Zambia Government International Bond	8.50%	04/14/2024		524		234,981	0.0
Zambia Government International Bond	8.97%	07/30/2027		2,372		1,062,211	0.1
						286,276,760	24.4
QUASI-STAATSANLEIHEN							
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	6.00%	11/18/2048		2,527		2,613,638	0.2
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	3.88%	06/19/2029		1,254		1,319,835	0.1
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	4.63%	03/14/2023		280		295,488	0.0
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.70%	01/30/2050		9,044		8,987,475	0.8
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031		578		618,460	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile	4.38%	02/05/2049		3,724		4,115,020	0.4
Empresa de Transmision Electrica SA	5.13%	05/02/2049		2,928		3,179,625	0.3
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	3.65%	05/07/2030		267		285,490	0.0
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	4.70%	05/07/2050		1,550		1,775,525	0.2
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	5.00%	01/25/2047		200		229,563	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025		4,593		4,157,383	0.4
Eskom Holdings SOC Ltd., Series 42	8.50%	04/25/2042	ZAR	2,000		82,942	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd., Series ES23	10.00%	01/25/2023		4,100		246,877	0.0
Housing & Development Board, Series 083	2.55%	11/20/2023	SGD	250		187,626	0.0

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	USD	532	$ 569,745	0.0%
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.80%	05/15/2050		892	957,562	0.1
KazMunayGas National Co. JSC	3.88%	04/19/2022		613	621,122	0.1
KazMunayGas National Co. JSC	5.38%	04/24/2030		4,350	4,862,484	0.4
Korea Development Bank (The)	4.50%	11/10/2020	CNH	1,000	140,806	0.0
MDGH - GMTN BV	2.88%	11/07/2029	USD	6,780	6,998,655	0.6
MDGH - GMTN BV	4.50%	11/07/2028		2,441	2,835,222	0.2
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.38%	07/19/2022		1,323	1,290,752	0.1
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2026		974	893,036	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027		429	435,703	0.0
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.63%	11/07/2024		1,970	2,038,950	0.2
Pertamina Persero PT	4.15%	02/25/2060		1,200	1,152,120	0.1
Pertamina Persero PT	5.63%	05/20/2043		425	474,273	0.0
Pertamina Persero PT	6.00%	05/03/2042		2,190	2,510,972	0.2
Pertamina Persero PT	6.45%	05/30/2044		1,084	1,323,835	0.1
Pertamina Persero PT	6.50%	05/27/2041		1,711	2,027,535	0.2
Perusahaan Listrik Negara PT	3.38%	02/05/2030		10,778	10,464,097	0.9
Perusahaan Listrik Negara PT	3.88%	07/17/2029		1,174	1,185,680	0.1
Perusahaan Listrik Negara PT	4.13%	05/15/2027		3,397	3,488,294	0.3
Perusahaan Listrik Negara PT	4.88%	07/17/2049		1,437	1,476,518	0.1
Perusahaan Listrik Negara PT	5.45%	05/21/2028		209	231,990	0.0
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031		4,974	4,022,723	0.3
Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027		2,194	1,937,576	0.2
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047		4,045	3,139,931	0.3
Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030		1,507	1,288,476	0.1
Petroleos Mexicanos	6.88%	08/04/2026		850	776,475	0.1
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060		7,252	5,540,528	0.5
Petroleos Mexicanos	7.19%	09/12/2024	MXN	8,420	317,418	0.0
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	USD	3,124	2,600,730	0.2
Petroleos Mexicanos, Series 14-2	7.47%	11/12/2026	MXN	10,740	373,699	0.0
Petronas Capital Ltd.	4.55%	04/21/2050	USD	993	1,224,617	0.1
Petronas Capital Ltd.	4.80%	04/21/2060		1,116	1,469,108	0.1
Southern Gas Corridor CJSC	6.88%	03/24/2026		705	810,309	0.1
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic	6.95%	03/18/2030		2,375	2,678,187	0.2
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025		706	709,026	0.1
Transnet SOC Ltd., Series TN20	10.50%	09/17/2020	ZAR	4,000	231,732	0.0
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	USD	1,492	1,284,985	0.1
					102,479,818	8.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	4.00%	10/03/2049		400	419,000	0.0
America Movil SAB de CV, Series 12	6.45%	12/05/2022	MXN	6,080	274,360	0.0
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	USD	299	269,167	0.0
Banco de Credito del Peru	4.85%	10/30/2020	PEN	47	13,793	0.0
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	3.73%	09/25/2034	USD	1,212	1,138,901	0.1
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.	0.00%	06/05/2034		1,091	745,971	0.1
BOC Aviation Ltd., Series G	4.50%	10/17/2020	CNH	2,000	282,489	0.0
Braskem America Finance Co.	7.13%	07/22/2041	USD	1,435	1,415,717	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028		1,202	1,090,214	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030		679	588,184	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	5.88%	01/31/2050		872	764,226	0.1
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026		230	218,285	0.0
BRF SA	4.88%	01/24/2030		3,006	2,773,035	0.2
Cable Onda SA.	4.50%	01/30/2030		474	461,119	0.0
CapitaMalls Asia Treasury Ltd.	3.70%	08/29/2022	SGD	250	179,829	0.0
Celulosa Arauco y Constitucion SA.	4.20%	01/29/2030	USD	2,213	2,215,470	0.2
Celulosa Arauco y Constitucion SA.	4.25%	04/30/2029		1,250	1,263,406	0.1
Cemig Geracao e Transmissao SA	9.25%	12/05/2024		949	1,019,434	0.1
Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.63%	02/04/2025		1,934	1,800,554	0.2
Centrais Eletricas Brasileiras SA	4.63%	02/04/2030		386	339,270	0.0
Colbun SA	4.50%	07/10/2024		1,608	1,683,576	0.1
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023		2,360	2,011,900	0.2
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026		240	195,562	0.0
Digicel Group Two Ltd.(b)	8.25%	09/30/2022		98	2,999	0.0
DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029		1,315	1,258,702	0.1
DP World PLC	5.63%	09/25/2048		865	875,948	0.1
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045		1,949	2,034,269	0.2
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027		590	536,599	0.1
Emgesa SA ESP	8.75%	01/25/2021	COP	261,000	71,236	0.0
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	USD	1,363	1,377,889	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029		1,331	1,305,628	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	8.38%	11/08/2027	COP	8,942,000	2,427,862	0.2
Enel Americas SA	4.00%	10/25/2026	USD	2,973	3,133,728	0.3
Enel Chile SA.	4.88%	06/12/2028		1,679	1,866,208	0.2
Enel Generacion Chile SA	4.25%	04/15/2024		1,522	1,595,722	0.1
Energa Finance AB	2.13%	03/07/2027	EUR	145	157,537	0.0
Energuate Trust	5.88%	05/03/2027	USD	379	365,166	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
Franshion Brilliant Ltd.	5.20%	03/08/2021	CNH	1,110	$ 157,134	0.0%
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027	USD	211	175,064	0.0
Gerdau Trade, Inc.	4.88%	10/24/2027		1,530	1,541,322	0.1
GNL Quintero SA	4.63%	07/31/2029		3,129	3,316,740	0.3
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.	6.25%	02/15/2025		1,818	450,399	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027		271	66,647	0.0
Grupo Energia Bogota SA ESP	4.88%	05/15/2030		795	847,510	0.1
Grupo Televisa SAB	7.25%	05/14/2043	MXN	5,680	189,791	0.0
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	USD	1,628	1,521,404	0.1
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR	10,000	131,090	0.0
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	USD	319	289,293	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	3.80%	11/07/2025	SGD	250	180,714	0.0
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd.	7.13%	10/10/2022	INR	100,000	1,257,996	0.1
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	3.30%	04/25/2022	CNH	2,040	289,495	0.0
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	3.75%	01/14/2028	USD	3,708	3,482,044	0.3
Intercorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027		2,645	2,586,314	0.2
Intercorp Peru Ltd.	3.88%	08/15/2029		1,011	962,346	0.1
Inversiones CMPC SA	3.85%	01/13/2030		1,015	1,021,438	0.1
Inversiones CMPC SA	4.38%	04/04/2027		1,751	1,840,739	0.2
Israel Electric Corp., Ltd., Series 6	5.00%	11/12/2024		294	323,536	0.0
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	7.25%	05/03/2023		709	701,910	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036		674	701,971	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034		1,323	1,512,766	0.1
Logan Property Holdings Co., Ltd.	6.13%	04/16/2021	SGD	250	178,281	0.0
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	USD	969	814,263	0.1
Mongolian Mining Corp./Energy Resources LLC	9.25%	04/15/2024		460	251,850	0.0
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034		1,490	1,374,467	0.1
NBM US Holdings, Inc.	6.63%	08/06/2029		400	402,602	0.0
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027		2,124	2,028,420	0.2
NTPC Ltd., Series E.	7.38%	08/10/2021	INR	10,000	131,090	0.0
Odebrecht Finance Ltd.(b)	5.25%	06/27/2029	USD	673	26,920	0.0
Orbia Advance Corp SAB de CV	4.00%	10/04/2027		5,459	5,378,821	0.5
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030		2,644	1,862,367	0.2
Petkim Petrokimya Holding AS	5.88%	01/26/2023		1,136	1,086,655	0.1
Petrobras Global Finance BV	5.09%	01/15/2030		39	37,306	0.0
Petrobras Global Finance BV	6.75%	01/27/2041		105	104,770	0.0
PTTEP Treasury Center Co., Ltd.	3.90%	12/06/2059		2,975	2,920,148	0.3
Rumo Luxembourg SARL	7.38%	02/09/2024		2,490	2,603,606	0.2
SABIC Capital II BV	4.50%	10/10/2028		598	656,679	0.1
Southern Copper Corp.	5.25%	11/08/2042		980	1,100,029	0.1
Southern Copper Corp.	5.88%	04/23/2045		910	1,092,501	0.1
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033		862	828,261	0.1
Stillwater Mining Co.	7.13%	06/27/2025		1,550	1,596,523	0.1
TransJamaican Highway Ltd.	5.75%	10/10/2036		1,352	1,261,162	0.1
Transportadora de Gas del Peru SA	4.25%	04/30/2028		226	241,184	0.0
Transportadora de Gas Internacional SA ESP	5.55%	11/01/2028		1,642	1,772,334	0.2
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030		933	806,753	0.1
Wijaya Karya Persero Tbk PT	7.70%	01/31/2021	IDR	30,360,000	1,974,086	0.2
					92,251,696	7.9
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN						
AB SICAV I - China A Shares Equity Portfolio				615,564	13,150,515	1.1
SCHATZOBLIGATIONEN						
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	4.70%	09/01/2030	CLP	110,000	168,233	0.0
Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP	860,900	237,159	0.0
Colombian TES, Series B	7.50%	08/26/2026		423,600	129,946	0.0
Indonesia Treasury Bond, Series FR56	8.38%	09/15/2026	IDR	314,000	22,888	0.0
Indonesia Treasury Bond, Series FR65	6.63%	05/15/2033		1,353,000	83,393	0.0
Indonesia Treasury Bond, Series FR68	8.38%	03/15/2034		2,583,000	183,515	0.0
Malaysia Government Bond, Series 0413	3.84%	04/15/2033	MYR	1,345	327,637	0.0
Peru Government Bond	5.40%	08/12/2034	PEN	120	37,752	0.0
Peru Government Bond	5.94%	02/12/2029		10,093	3,382,288	0.3
Peru Government Bond	6.90%	08/12/2037		755	268,621	0.0
Peru Government Bond	8.20%	08/12/2026		620	233,690	0.0
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212.	7.05%	01/19/2028	RUB	11,707	185,077	0.0
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6215.	7.00%	08/16/2023		37,560	569,125	0.1
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6222.	7.10%	10/16/2024		21,840	336,533	0.1
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6226.	7.95%	10/07/2026		5,964	97,721	0.0
					6,263,578	0.5
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2023	BRL	948	201,561	0.0
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2029		869	193,313	0.0
Egypt Government Bond, Series 10YR	16.10%	05/07/2029	EGP	1,900	127,650	0.0
Egypt Government Bond, Series 7Y	14.22%	10/15/2026		3,000	191,750	0.0
Republic of South Africa Government Bond, Series 2032	8.25%	03/31/2032	ZAR	2,764	141,277	0.0
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048	8.75%	02/28/2048		2,502	115,350	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettovermögen %
Republic of South Africa Government Bond, Series R213	7.00%	02/28/2031	ZAR	7,890	$ 378,035	0.1%
Ukraine Government Bond	16.75%	06/02/2021	UAH	4,035	156,323	0.0
					1,505,259	0.1
REGIONALANLEIHEN						
Provincia de Neuquen Argentina	7.50%	04/27/2025	USD	736	333,500	0.0
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE						
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series B	6.00%	08/15/2050	BRL	100	76,880	0.0
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP	500,000	91,153	0.0
					168,033	0.0
GEKAUFTE KAUFOPTIONEN						
OPTIONEN AUF TERMINKONTRAKTE						
JPY/USD						
Expiration: Aug 2020, Exercise Price: JPY 110.75(d)				26,580,000	7,166	0.0
MXN/USD						
Expiration: Feb 2021, Exercise Price: MXN 20.00(d)				4,800,000	1,853	0.0
					9,019	0.0
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN						
OPTIONEN AUF TERMINKONTRAKTE						
JPY/USD_1						
Expiration: Aug 2020, Exercise Price: JPY 110.75(d)			USD	26,580,000	386	0.0
					1,079,752,971	91.9
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
AES Gener SA	6.35%	10/07/2079		590	564,424	0.1
Alpek SAB de CV	4.25%	09/18/2029		359	351,102	0.0
Banco Macro SA	17.50%	05/08/2022	ARS	3,390	18,226	0.0
Digicel Group One Ltd.(b)	8.25%	12/30/2022	USD	44	25,963	0.0
Digicel Group Two Ltd.(b)	8.25%	09/30/2022		4,453	136,279	0.0
Engie Energia Chile SA	3.40%	01/28/2030		2,778	2,799,835	0.2
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030		1,421	1,223,481	0.1
Industrias Penoles SAB de CV	4.15%	09/12/2029		3,591	3,679,092	0.3
Inversiones CMPC SA/Cayman Islands Branch	4.38%	05/15/2023		489	508,254	0.1
Kenbourne Invest SA	6.88%	11/26/2024		1,093	1,090,268	0.1
Odebrecht Finance Ltd.(b)	7.13%	06/26/2042		1,190	20,081	0.0
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.	0.00%	09/30/2036		780	493,619	0.1
Tonon Luxembourg SA(e) (f)	6.50%	10/31/2024		538	16,194	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b)	10.88%	01/13/2020		1,077	286,751	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b)	11.75%	02/09/2022		1,240	11,654	0.0
					11,225,223	1.0
AKTIENANLEIHEN						
FPT Corp., Macquarie Bank Ltd.(f)		04/05/2021		5,333	10,984,647	0.9
STAATSANLEIHEN						
El Salvador Government International Bond	8.25%	04/10/2032	USD	1,670	1,390,797	0.1
Republic of Azerbaijan International Bond	5.13%	09/01/2029		520	539,499	0.1
Ukraine Government International Bond	6.75%	06/20/2026	EUR	745	798,560	0.1
Venezuela Government International Bond(b)	11.95%	08/05/2031	USD	4,466	245,603	0.0
Venezuela Government International Bond(b)	12.75%	08/23/2022		7,624	419,336	0.0
					3,393,795	0.3
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
Argentine Bonos del Tesoro(b)	15.50%	10/17/2026	ARS	2,564	9,038	0.0
Ukraine Government Bond	16.75%	06/02/2021	UAH	75,228	2,914,456	0.3
					2,923,494	0.3
STAMMAKTIEN						
Commercial Bank of Ceylon PLC				1,092,470	369,821	0.0
Tatneft PJSC (Sponsored ADR)				25,213	1,134,585	0.1
					1,504,406	0.1
SCHATZOBLIGATIONEN						
Malaysia Government Bond, Series 0217	4.06%	09/30/2024	MYR	1,250	305,968	0.1
Malaysia Government Bond, Series 0218	3.76%	04/20/2023		950	227,191	0.0
					533,159	0.1
QUASI-STAATSANLEIHEN						
Petroleos de Venezuela SA(b)	5.38%	04/12/2027	USD	3,704	116,663	0.0
Petroleos de Venezuela SA(b)	6.00%	11/15/2026		5,448	171,612	0.0
Petroleos de Venezuela SA(b)	9.00%	11/17/2021		2,963	93,330	0.0
					381,605	0.0
					30,946,329	2.7
Gesamtanlagen						
(Kosten $1,187,556,538)					$ 1,110,699,300	94.6%

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Termineinlagen				
BBH, Grand Cayman(g)	(1.39)%	–	$ 480	0.0%
BBH, Grand Cayman(g)	(0.30)%	–	1,198	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	(0.25)%	–	4,810	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	0.01 %	–	18,019	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	0.03 %	–	552,877	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	0.04 %	–	3,248	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	2.75 %	–	271,746	0.0
DBS Bank Ltd, Singapore(g)	0.01 %	–	28,848,994	2.5
HSBC France S.A., Paris(g)	(0.67)%	–	1,803,287	0.2
MUFG, Tokyo(g)	(0.26)%	–	38,451	0.0
National Australia Bank, London(g)	0.01 %	–	74,512	0.0
Sumitomo, London(g)	0.01 %	–	59,966	0.0
Termineinlagen insgesamt			31,677,588	2.7
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			32,081,037	2.7
Nettovermögen			$ 1,174,457,925	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2020	7	$ 1,533,141	$ 1,526,219	$ (6,922)
Short					
MSCI Emerging Markets Index Futures	06/19/2020	767	33,607,575	35,776,715	(2,169,140)
					$ (2,176,062)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	CNH	257,290	USD	36,368	06/16/2020	$ 356,830
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	USD	518	CNH	3,674	06/16/2020	(3,941)
Bank of America, NA.	EUR	1,125	USD	1,216	06/10/2020	(32,717)
Bank of America, NA.	USD	4,878	EUR	4,492	06/10/2020	108,917
Bank of America, NA.	AUD	2,487	USD	1,547	06/11/2020	(110,265)
Bank of America, NA.	MXN	166,513	USD	6,937	06/19/2020	(552,658)
Bank of America, NA.	RUB	501,022	USD	6,792	07/14/2020	(273,824)
Bank of America, NA.	USD	72	RUB	5,168	07/14/2020	576
Bank of America, NA.	INR	280,124	USD	3,668	07/23/2020	(21,552)
Bank of America, NA.	USD	2,107	IDR	31,357,880	07/23/2020	12,944
Bank of America, NA.	USD	5,155	INR	392,770	07/23/2020	18,743
Bank of America, NA.	PHP	66,577	USD	1,301	08/19/2020	(10,818)
Barclays Bank PLC	USD	37	BRL	205	06/02/2020	1,548
Barclays Bank PLC	CNH	27,900	USD	3,886	06/16/2020	(19,053)
Barclays Bank PLC	MXN	66,229	USD	2,768	06/19/2020	(211,164)
Barclays Bank PLC	USD	16,683	MXN	410,479	06/19/2020	1,780,631
Barclays Bank PLC	USD	19	RUB	1,333	07/14/2020	74
Barclays Bank PLC	INR	17,814	USD	231	07/23/2020	(3,934)
Barclays Bank PLC	USD	207	INR	16,020	07/23/2020	4,095
Barclays Bank PLC	USD	2,252	HUF	731,922	07/29/2020	88,009
Barclays Bank PLC	MYR	362	USD	83	08/13/2020	(5)
Barclays Bank PLC	MYR	271,308	USD	64,009	08/13/2020	1,707,212
Barclays Bank PLC	USD	156	KRW	190,427	08/13/2020	(1,614)
Barclays Bank PLC	USD	52,656	MYR	219,251	08/13/2020	(2,308,180)
Barclays Bank PLC	USD	3,714	MYR	16,266	08/13/2020	21,588
Barclays Bank PLC	TWD	8,485	USD	284	08/20/2020	(639)
Barclays Bank PLC	USD	111	TWD	3,254	08/20/2020	(1,603)
BNP Paribas SA	BRL	73,782	USD	13,720	06/02/2020	(106,188)
BNP Paribas SA	USD	81	BRL	434	06/02/2020	624
BNP Paribas SA	CNH	42,587	USD	6,015	06/16/2020	53,978
BNP Paribas SA	USD	100	CNH	714	06/16/2020	(338)
BNP Paribas SA	BRL	434	USD	80	07/02/2020	(620)
BNP Paribas SA	USD	13,699	BRL	73,782	07/02/2020	105,591
BNP Paribas SA	ZAR	2,056	USD	117	07/17/2020	872
BNP Paribas SA	IDR	1,779,881	USD	112	07/23/2020	(8,544)
BNP Paribas SA	USD	152	INR	11,844	07/23/2020	3,586
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD	1,045	USD	625	06/04/2020	(23,233)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	518	NZD	868	06/04/2020	20,892
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	44,899	USD	421	06/05/2020	4,443
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	13	JPY	1,368	06/05/2020	(52)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	503	JPY	54,754	06/05/2020	$ 5,079
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	141	USD	153	06/10/2020	(4,059)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	221	EUR	201	06/10/2020	1,353
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	577	USD	359	06/11/2020	(25,642)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	209	AUD	331	06/11/2020	11,138
Brown Brothers Harriman & Co.	CNH	1,132	USD	159	06/16/2020	119
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	14,266	USD	597	06/19/2020	(44,461)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	713	MXN	17,292	06/19/2020	64,738
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	166	ZAR	3,057	07/17/2020	7,196
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	1,959	USD	107	07/17/2020	(3,613)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	174	CZK	4,414	07/29/2020	8,502
Brown Brothers Harriman & Co.	SGD	249	USD	175	08/27/2020	(1,332)
Brown Brothers Harriman & Co.	THB	111,056	USD	3,478	08/27/2020	(12,707)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	3,806	SGD	5,422	08/27/2020	33,717
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	6,274	THB	200,084	08/27/2020	13,963
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	297	CHF	287	08/28/2020	2,381
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	73,732	AUD	113,812	06/12/2020	2,130,105
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	11,377	CAD	15,923	06/12/2020	187,488
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	106	CHF	103	06/12/2020	1,010
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	31,248	EUR	28,827	06/12/2020	757,020
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	118,201	GBP	95,954	06/12/2020	306,183
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	119	JPY	12,798	06/12/2020	(532)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	9,479	ZAR	174,982	06/12/2020	480,778
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	677	CNH	4,827	06/22/2020	(3,712)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	44,827	SGD	63,419	06/22/2020	63,614
Citibank NA	BRL	24,813	USD	4,286	06/02/2020	(364,362)
Citibank NA	USD	16,443	BRL	88,865	06/02/2020	210,145
Citibank NA	USD	3,882	MXN	95,480	06/19/2020	412,468
Citibank NA	CLP	4,634,007	USD	5,535	07/15/2020	(254,979)
Citibank NA	COP	12,560,054	USD	3,171	07/15/2020	(182,878)
Citibank NA	PEN	57	USD	16	07/15/2020	(19)
Citibank NA	USD	2,556	COP	9,713,392	07/15/2020	37,742
Citibank NA	USD	2,842	ZAR	49,634	07/17/2020	(28,002)
Citibank NA	ZAR	125,274	USD	7,011	07/17/2020	(92,147)
Citibank NA	USD	22,384	INR	1,748,824	07/23/2020	653,395
Citibank NA	HUF	1,547,793	USD	4,852	07/29/2020	(95,752)
Citibank NA	PLN	62,983	USD	15,144	07/29/2020	(556,691)
Citibank NA	USD	3,404	HUF	1,079,990	07/29/2020	48,126
Citibank NA	KRW	12,639,874	USD	10,397	08/13/2020	141,544
Citibank NA	USD	2,878	KRW	3,541,370	08/13/2020	(4,740)
Citibank NA	USD	9,258	TWD	274,832	08/20/2020	(36,651)
Citibank NA	USD	5,817	SGD	8,226	08/27/2020	7,809
Deutsche Bank AG	EUR	15,886	USD	17,198	06/10/2020	(438,651)
Deutsche Bank AG	PEN	29,780	USD	8,699	07/15/2020	15,041
Deutsche Bank AG	USD	153	PEN	524	07/15/2020	(265)
Deutsche Bank AG	IDR	50,821,296	USD	3,341	07/23/2020	(94,592)
Deutsche Bank AG	USD	4,662	INR	355,533	07/23/2020	21,860
Goldman Sachs Bank USA	CNH	275,744	USD	38,742	06/16/2020	147,231
Goldman Sachs Bank USA	USD	31,314	CNH	222,448	06/16/2020	(179,037)
Goldman Sachs Bank USA	USD	3,165	MXN	73,011	06/19/2020	118,530
Goldman Sachs Bank USA	BRL	18,692	USD	3,503	07/02/2020	6,194
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,319	IDR	19,765,750	07/23/2020	17,285
Goldman Sachs Bank USA	USD	4,845	INR	373,148	07/23/2020	69,956
Goldman Sachs Bank USA	KRW	2,937,842	USD	2,366	08/13/2020	(17,603)
Goldman Sachs Bank USA	MYR	77,905	USD	17,723	08/13/2020	(166,770)
Goldman Sachs Bank USA	MYR	45,559	USD	10,954	08/13/2020	492,334
Goldman Sachs Bank USA	USD	59,022	MYR	252,148	08/13/2020	(1,119,403)
Goldman Sachs Bank USA	USD	10,509	MYR	46,154	08/13/2020	89,801
Goldman Sachs Bank USA	PHP	319,208	USD	6,248	08/19/2020	(43,688)
HSBC Bank USA	USD	3,844	CNH	27,201	06/16/2020	(36,395)
HSBC Bank USA	USD	1,252	TRY	8,564	06/30/2020	(7,707)
HSBC Bank USA	USD	7,213	ZAR	134,709	07/17/2020	425,596
HSBC Bank USA	USD	174	KRW	215,510	08/13/2020	364
HSBC Bank USA	USD	982	TWD	28,967	08/20/2020	(10,149)
JPMorgan Chase Bank, NA	MXN	48,862	USD	2,008	06/19/2020	(189,949)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	3,241	MXN	80,745	06/19/2020	390,604
JPMorgan Chase Bank, NA	COP	240,756	USD	62	07/15/2020	(2,727)
JPMorgan Chase Bank, NA	COP	13,298,960	USD	3,555	07/15/2020	3,465
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	28,341	ZAR	524,417	07/17/2020	1,395,702
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	134	INR	10,299	07/23/2020	1,539
JPMorgan Chase Bank, NA	CZK	212,432	USD	8,362	07/29/2020	(404,108)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	3,490	THB	111,056	08/27/2020	681
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	10,381	BRL	59,461	06/02/2020	761,324
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	15,503	CNH	110,093	06/16/2020	(94,010)
Morgan Stanley Capital Services LLC	TRY	50,098	USD	7,384	06/30/2020	103,201

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,553	RUB	115,949	07/14/2020	$ 82,608
Morgan Stanley Capital Services LLC	COP	15,632,792	USD	4,136	07/15/2020	(39,041)
Morgan Stanley Capital Services LLC	INR	110,499	USD	1,455	07/23/2020	(690)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	24,443	IDR	389,235,365	07/23/2020	1,867,110
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW	12,075,196	USD	9,844	08/13/2020	47,364
Morgan Stanley Capital Services LLC	MYR	112,335	USD	24,913	08/13/2020	(882,949)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	7,799	MYR	34,023	08/13/2020	14,348
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	733	SGD	1,038	08/27/2020	1,515
Royal Bank of Scotland PLC	COP	1,793,376	USD	450	07/15/2020	(28,829)
Royal Bank of Scotland PLC	USD	227	COP	905,268	07/15/2020	14,552
Standard Chartered Bank	BRL	528	USD	93	06/02/2020	(6,137)
Standard Chartered Bank	USD	158	BRL	891	06/02/2020	8,669
Standard Chartered Bank	IDR	37,701,628	USD	2,352	07/23/2020	(196,351)
Standard Chartered Bank	INR	8,617	USD	112	07/23/2020	(1,397)
Standard Chartered Bank	USD	1,325	IDR	20,040,501	07/23/2020	29,927
Standard Chartered Bank	USD	222	INR	17,065	07/23/2020	2,833
Standard Chartered Bank	USD	114	KRW	139,692	08/13/2020	(604)
Standard Chartered Bank	USD	1,666	PHP	85,107	08/19/2020	11,876
Standard Chartered Bank	TWD	73,340	USD	2,452	08/20/2020	(8,805)
Standard Chartered Bank	TWD	90,201	USD	3,063	08/20/2020	36,172
Standard Chartered Bank	USD	450	TWD	13,282	08/20/2020	(3,919)
State Street Bank & Trust Co.	USD	3,649	SGD	5,179	08/27/2020	18,331
UBS AG	BRL	50,732	USD	8,991	06/02/2020	(515,757)
UBS AG	CNH	1,187	USD	168	06/16/2020	2,143
UBS AG	USD	22,864	CNH	162,779	06/16/2020	(80,785)
UBS AG	IDR	41,848,926	USD	2,704	07/23/2020	(124,465)
UBS AG	USD	6,087	INR	472,248	07/23/2020	133,590
UBS AG	TWD	172,613	USD	5,768	08/20/2020	(24,001)
UBS AG	THB	45,816	USD	1,437	08/27/2020	(2,713)
						$ 6,083,794
					Wertsteigerung	$ 16,208,512
					Wertminderung	$ (10,124,718)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

VERKAUFTE WÄHRUNGSOPTIONEN

Bezeichnung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Kontrakte (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Goldman Sachs Bank USA - Call - JPY vs. USD (d)	JPY 110.75	Aug 2020	JPY 26,580	$ 22,128	$ (7,166)

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Brazil	06/20/2025	USD 18,511	$ 1,596,989	$ 82,409
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of South Africa	06/20/2025	19,215	2,171,503	19,530
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Turkey	06/20/2025	21,079	4,098,307	24,961
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Turkey	06/20/2025	3,640	(707,711)	18,378
Insgesamt				$ 7,159,088	$ 145,278

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

			Zinsart		
Clearing-Broker/(Börse)	Nominalbetrag (000)	Abschlussdatum	Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 22,650	09/16/2049	3 Month LIBOR	1.836%	$ 5,482,570

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Vorabgebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Morgan Stanley & Co. International PLC	Ukraine International Bond	06/20/2025 USD	522	$ (113,177)	$ (140,310)	$ 27,133

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Goldman Sachs International					
MSCI Emerging Markets Growth	270,429	LIBOR Plus 0.33%	USD 103,163	12/15/2020	$ 16,058,074

VARIANZ-SWAP

Swap-Kontrahent & Referenz-Obligation	Volatilitäts-Ausübungskurs	Nomineller Betrag (000)		Marktwert	Vorab-gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte						
JPMorgan Chase Bank, NA						
Hang Seng China Enterprises Index 06/29/2020*	20.34%	HKD	617	$ 1,017,060	$ —	$ 1,017,06
Hang Seng China Enterprises Index 06/29/2020*	20.54%	HKD	442	580,196	—	580,196
Hang Seng China Enterprises Index 06/29/2020*	20.94%	HKD	1,335	1,651,023	—	1,651,023
Hang Seng China Enterprises Index 06/29/2020*	21.29%	HKD	1,322	1,548,743	—	1,548,743
Verkaufskontrakte						
JPMorgan Chase Bank, NA						
Hang Seng China Enterprises Index 06/29/2020*	21.10%	HKD	1,252	(2,773,273)	—	(2,773,273)
UBS AG						
Hang Seng China Enterprises Index 06/29/2020*	21.20%	HKD	1047	(2,294,666)	—	(2,294,666)
				$ (270,917)	$ —	$ (270,917)
					Wertsteigerung	$ 4,797,022
					Wertminderung	$ (5,067,939)
Swaps insgesamt						$ 21,442,138

* Abschlussdatum.

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

(b) Not leidend.

(c) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. Mai 2020.

(d) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.

(e) Zahlungen in Sachwerten (PIK).

(f) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

(g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

ARS – Argentine Peso
AUD – Australian Dollar
BRL – Brazilian Real
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
CLP – Chilean Peso
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
COP – Colombian Peso
CZK – Czech Koruna
EGP – Egyptian Pound
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
HKD – Hong Kong Dollar
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
PEN – Peruvian Sol
PHP – Philippine Peso
PLN – Polish Zloty

RUB – Russian Ruble
SGD – Singapore Dollar
THB – Thailand Baht
TRY – Turkish Lira
TWD – New Taiwan Dollar
UAH – Ukrainian Hryvnia
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
CBT – Chicago Board of Trade
CJSC – Closed Joint Stock Company
CME – Chicago Mercantile Exchange
GDR – Global Depositary Receipt
GMTN – Global Medium Term Note
HIBOR – Hong Kong Interbank Offered Rate
HK – Hong Kong
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
JSC – Joint Stock Company
LIBOR – London Interbank Offered Rate
MSCI – Morgan Stanley Capital International
PJSC – Public Joint Stock Company
REIT – Real Estate Investment Trust

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (CNH)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE							
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE							
QUASI-STAATSANLEIHEN							
CHINA							
Agricultural Development Bank of China, Series 1705	3.85%	01/06/2027	CNY	30,000	¥	31,302,393	2.4%
China Development Bank, Series 1710	4.04%	04/10/2027		40,000		42,389,479	3.3
China Development Bank, Series 1806	4.73%	04/02/2025		40,000		43,428,867	3.3
China Development Bank, Series 1810	4.04%	07/06/2028		46,000		48,372,605	3.7
China Development Bank, Series 1905	3.48%	01/08/2029		70,000		70,961,263	5.4
China Development Bank, Series 1909	3.50%	08/13/2026		65,000		66,569,089	5.1
China Development Bank, Series 2003	3.23%	01/10/2025		10,000		10,273,055	0.8
China Development Bank, Series 2004	3.43%	01/14/2027		10,000		10,209,716	0.8
China Minmetals Corp.(a)	4.45%	05/13/2021	USD	500		3,594,476	0.3
Chinalco Capital Holdings Ltd.(a)	4.10%	09/11/2024		900		6,271,605	0.5
Chinalco Capital Holdings Ltd.	4.25%	04/21/2022		220		1,579,814	0.1
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	4.63%	03/14/2023		1,800		13,598,208	1.0
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	4.88%	03/14/2025		1,600		12,488,178	1.0
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	5.13%	03/14/2028		900		7,223,922	0.5
Dianjian Haiyu Ltd.(a)	3.50%	06/14/2022		500		3,569,233	0.3
Export-Import Bank of China (The)	4.15%	06/18/2027	CNH	30,000		32,374,200	2.5
Leader Goal International Ltd.(a)	4.25%	01/19/2023	USD	600		4,307,240	0.3
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.(a)	3.38%	09/03/2024		750		5,321,972	0.4
SPIC 2018 USD Senior Perpetual Bond Co., Ltd.(a)	5.80%	05/21/2022		200		1,477,803	0.1
Sunny Express Enterprises Corp.	2.63%	04/23/2025		1,000		7,291,350	0.6
Sunny Express Enterprises Corp.	3.13%	04/23/2030		824		6,051,717	0.5
						428,656,185	32.9
INDONESIEN							
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025		643		4,791,472	0.4
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030		309		2,368,949	0.2
Pelabuhan Indonesia II PT	4.25%	05/05/2025		1,600		11,611,249	0.9
Pertamina Persero PT	4.18%	01/21/2050		1,000		6,961,739	0.5
						25,733,409	2.0
MALAYSIA							
Petronas Capital Ltd.	4.55%	04/21/2050		1,010		8,916,627	0.7
SÜDKOREA							
Korea Resources Corp.	4.00%	04/18/2023		700		5,290,334	0.4
						468,596,555	36.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT							
FINANZINSTITUTE							
BANKWESEN							
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	3.73%	09/25/2034		500		3,363,424	0.3
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	9.03%	03/15/2029		500		4,652,690	0.4
Bank of China Ltd./Hong Kong	4.45%	11/20/2021	CNH	10,000		10,296,875	0.8
Busan Bank Co., Ltd., Series G	4.85%	05/25/2021		20,000		20,361,977	1.6
DBS Group Holdings Ltd., Series G(a)	3.30%	02/27/2025	USD	500		3,471,921	0.3
Industrial & Commercial Bank of China Ltd./Singapore	4.50%	10/22/2021	CNH	5,000		5,145,313	0.4
Kasikornbank PCL/Hong Kong	3.34%	10/02/2031	USD	500		3,320,919	0.3
Kookmin Bank	1.75%	05/04/2025		465		3,391,163	0.3
Kookmin Bank(a)	4.35%	07/02/2024		1,000		7,217,853	0.5
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	3.34%	02/05/2030		1,500		11,026,481	0.8
Shinhan Financial Group Co., Ltd.(a)	5.88%	08/13/2023		600		4,489,784	0.3
Woori Bank	4.75%	04/30/2024		900		6,899,772	0.5
Woori Bank	5.13%	08/06/2028		200		1,643,764	0.1
						85,281,936	6.6
MAKLER							
China Great Wall International Holdings IV Ltd.(a)	3.95%	07/31/2024		500		3,552,455	0.3
FINANZEN							
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.(a)	4.50%	01/24/2022		1,000		7,189,919	0.5
Huarong Finance II Co., Ltd.	3.63%	11/22/2021		1,900		13,733,103	1.1
Soar Wise Ltd.(a)	3.45%	10/23/2022		600		4,193,583	0.3
						25,116,605	1.9
SONSTIGE FINANZWERTE							
China Cinda 2020 I Management Ltd.	2.00%	03/18/2023		1,000		7,165,296	0.5
REITS							
Central China Real Estate Ltd.	6.88%	02/10/2021		600		4,284,422	0.3
Country Garden Holdings Co., Ltd.	4.75%	09/28/2023		1,100		7,880,420	0.6
Country Garden Holdings Co., Ltd.	6.15%	09/17/2025		250		1,857,645	0.1
Franshion Brilliant Ltd.	4.25%	07/23/2029		687		4,778,584	0.4
Franshion Brilliant Ltd.	5.20%	03/08/2021	CNH	9,000		9,093,513	0.7
Hongkong Land Finance Cayman Islands Co., Ltd. (The)	2.88%	05/27/2030	USD	529		3,841,143	0.3
Shimao Property Holdings Ltd.	6.13%	02/21/2024		600		4,503,413	0.4

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (CNH)	Nettover-mögen %
	Shimao Property Holdings Ltd.	6.38%	10/15/2021	USD	900	¥	6,627,969	0.5%
	Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd.	4.75%	08/05/2029		400		2,775,747	0.2
							45,642,856	3.5
							166,759,148	12.8
INDUSTRIE								
GRUNDSTOFFE								
	Bluestar Finance Holdings Ltd.	3.38%	07/16/2024		800		5,850,366	0.5
	Bluestar Finance Holdings Ltd.(a)	6.25%	11/07/2021		600		4,410,592	0.3
	Jiangxi Railway Investment Group Co., Ltd.	4.85%	02/21/2022		400		2,905,497	0.2
							13,166,455	1.0
KOMMUNIKATIONSMEDIEN								
	Tencent Holdings Ltd.	3.24%	06/03/2050		1,509		10,697,941	0.8
	Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024		914		6,692,172	0.5
							17,390,113	1.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ								
	Daimler International Finance BV	3.78%	03/22/2022	CNH	9,000		9,172,531	0.7
	Daimler International Finance BV	4.50%	09/21/2021		7,000		7,139,206	0.5
	Weichai International Hong Kong Energy Group Co., Ltd.(a)	3.75%	09/14/2022	USD	857		6,037,145	0.5
							22,348,882	1.7
ENERGIE								
	BPRL International Singapore Pte Ltd.	4.38%	01/18/2027		400		2,884,916	0.2
	COSL Singapore Capital Ltd.	4.50%	07/30/2025		500		3,933,874	0.3
	Sinopec Century Bright Capital Investment Ltd.	4.50%	10/31/2021	CNH	20,000		20,518,750	1.6
	Thaioil Treasury Center Co., Ltd.	5.38%	11/20/2048	USD	465		3,857,188	0.3
							31,194,728	2.4
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE								
	CK Hutchison Capital Securities 17 Ltd.(a)	4.00%	05/12/2022		1,655		11,806,568	0.9
TECHNOLOGIE								
	Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030		800		6,113,462	0.5
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN								
	CRCC Chengan Ltd.(a)	3.97%	06/27/2024		500		3,588,248	0.3
							105,608,456	8.1
VERSORGUNGSBETRIEBE								
ELEKTRIZITÄT								
	Adani Electricity Mumbai Ltd.	3.95%	02/12/2030		700		4,627,364	0.4
	Adani Transmission Ltd.	4.25%	05/21/2036		597		4,053,322	0.3
	CLP Power HK Finance Ltd.(a)	3.55%	11/06/2024		200		1,379,444	0.1
	LLPL Capital Pte Ltd.	6.88%	02/04/2039		398		3,001,208	0.2
	Minejesa Capital BV	4.63%	08/10/2030		866		6,153,789	0.5
	NTPC Ltd.	4.25%	02/26/2026		300		2,250,261	0.2
							21,465,388	1.7
ERDGAS								
	Perusahaan Gas Negara Tbk PT.	5.13%	05/16/2024		2,000		14,701,975	1.1
							36,167,363	2.8
							308,534,967	23.7
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN								
FINANZINSTITUTE								
BANKWESEN								
	Bank of East Asia Ltd. (The)(a)	5.50%	12/02/2020		400		2,826,752	0.2
	Bank of East Asia Ltd. (The)(a)	5.88%	09/19/2024		372		2,543,164	0.2
	Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT	4.20%	01/23/2025		243		1,620,490	0.1
	TMB Bank PCL/Cayman Islands(a)	4.90%	12/02/2024		1,200		7,717,866	0.6
	Woori Bank(a)	5.25%	05/16/2022		1,000		7,234,660	0.6
							21,942,932	1.7
FINANZEN								
	Central Huijin Investment Ltd.	3.45%	05/22/2022	CNY	10,000		10,214,199	0.8
REITS								
	Central China Real Estate Ltd.	7.90%	11/07/2023	USD	600		4,220,576	0.3
	China Aoyuan Group Ltd.	7.95%	09/07/2021		400		2,906,392	0.2
	China SCE Group Holdings Ltd.	7.25%	04/19/2023		600		4,178,576	0.3
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	6.45%	11/07/2024		600		4,238,976	0.3
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	6.70%	04/23/2022	CNH	5,000		5,032,196	0.4
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	7.38%	10/04/2021	USD	600		4,126,210	0.3
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	10.88%	01/09/2023		200		1,392,348	0.1
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	11.75%	04/17/2022		700		5,048,603	0.4
	Jababeka International BV	6.50%	10/05/2023		200		1,092,581	0.1
	Kaisa Group Holdings Ltd.	11.25%	04/09/2022		700		4,998,492	0.4
	KWG Group Holdings Ltd.	7.88%	08/09/2021		500		3,627,397	0.3

		Zinssatz	Datum		Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (CNH)	Nettovermögen %
	KWG Group Holdings Ltd.	7.88%	09/01/2023	USD	400	¥	2,874,787	0.2%
	Logan Property Holdings Co., Ltd.	7.50%	08/27/2021		200		1,464,305	0.1
	Logan Property Holdings Co., Ltd.	7.50%	08/25/2022		400		2,956,555	0.2
	Logan Property Holdings Co., Ltd.	8.75%	12/12/2020		300		2,185,163	0.2
	Modernland Overseas Pte Ltd.	6.95%	04/13/2024		200		800,868	0.1
	Redsun Properties Group Ltd.	9.70%	04/16/2023		300		2,024,374	0.1
	Redsun Properties Group Ltd.	9.95%	04/11/2022		700		4,939,641	0.4
	RKPF Overseas 2019 A Ltd.	6.70%	09/30/2024		800		5,642,766	0.4
	Ronshine China Holdings Ltd.	10.50%	03/01/2022		900		6,770,917	0.5
	Scenery Journey Ltd.	9.00%	03/06/2021		400		2,819,593	0.2
	Scenery Journey Ltd.	11.50%	10/24/2022		400		2,526,986	0.2
	Times China Holdings Ltd.	7.63%	02/21/2022		500		3,651,719	0.3
	Times China Holdings Ltd.	10.95%	11/27/2020		500		3,668,668	0.3
	Yango Justice International Ltd.	8.25%	11/25/2023		200		1,318,972	0.1
	Yuzhou Properties Co., Ltd.	6.00%	10/25/2023		700		4,696,404	0.4
	Zhenro Properties Group Ltd.	9.80%	08/20/2021		200		1,465,723	0.1
	Zhenro Properties Group Ltd.	12.50%	01/02/2021		200		1,475,570	0.1
							92,145,358	7.0
							124,302,489	9.5
INDUSTRIE								
GRUNDSTOFFE								
	ABJA Investment Co. Pte Ltd.	5.45%	01/24/2028		1,200		7,692,374	0.6
	Press Metal Labuan Ltd.	4.80%	10/30/2022		600		3,726,051	0.3
	Tianqi Finco Co., Ltd.	3.75%	11/28/2022		565		1,415,613	0.1
	Vedanta Resources Ltd.	6.13%	08/09/2024		750		2,654,275	0.2
							15,488,313	1.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE								
	Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029		600		4,190,465	0.3
	MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026		200		1,426,351	0.1
	Wynn Macau Ltd.	5.13%	12/15/2029		338		2,347,019	0.2
							7,963,835	0.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS								
	Jollibee Worldwide Pte Ltd.(a)	3.90%	01/23/2025		300		1,978,458	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER								
	SM Investments Corp.	4.88%	06/10/2024		1,500		11,238,394	0.9
ENERGIE								
	Greenko Solar Mauritius Ltd.	5.95%	07/29/2026		600		4,095,167	0.3
	HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026		439		2,849,969	0.2
	Medco Bell Pte Ltd.	6.38%	01/30/2027		472		2,616,504	0.2
	Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026		400		2,406,184	0.2
	Mongolian Mining Corp./Energy Resources LLC	9.25%	04/15/2024		400		1,567,733	0.1
							13,535,557	1.0
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE								
	Li & Fung Ltd.(a)	5.25%	11/03/2021		500		2,343,323	0.2
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN								
	Royal Capital BV(a)	5.88%	05/05/2022		600		4,193,150	0.3
							56,741,030	4.4
VERSORGUNGSBETRIEBE								
ELEKTRIZITÄT								
	SMC Global Power Holdings Corp.(a)	5.95%	05/05/2025		400		2,608,415	0.2
	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033		181		1,248,250	0.1
							3,856,665	0.3
							184,900,184	14.2
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN								
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS								
	AB SICAV I - China Bond - Class SA				954,175		99,129,223	7.6
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE								
CHINA								
	China Government Bond, Series 1906	3.29%	05/23/2029	CNY	20,000		20,762,705	1.6
	China Government Bond, Series INBK	3.39%	03/16/2050		20,000		19,666,314	1.5
							40,429,019	3.1
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN								
	Central American Bank for Economic Integration	4.20%	09/21/2021	CNH	13,000		13,066,550	1.0
	Central American Bank for Economic Integration	4.85%	05/23/2023		13,000		13,023,651	1.0
							26,090,201	2.0
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN								
SÜDKOREA								
	Industrial Bank of Korea(a)	3.90%	07/31/2022	USD	729		5,142,949	0.4

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (CNH)	Nettover-mögen %
VIETNAM								
	Viet Nam Debt & Asset Trading Corp.	1.00%	10/10/2025	USD	1,300	¥	7,043,615	0.6%
							12,186,564	1.0
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE								
PAKISTAN								
	Pakistan Government International Bond	8.25%	09/30/2025		350		2,471,059	0.2
SRI LANKA								
	Sri Lanka Government International Bond	6.85%	11/03/2025		400		1,565,944	0.1
							4,037,003	0.3
							1,143,903,716	87.9
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE								
QUASI-STAATSANLEIHEN								
SÜDKOREA								
	Korea Development Bank (The), Series G	4.60%	07/03/2021	CNH	16,500		16,927,969	1.3
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT								
FINANZINSTITUTE								
BANKWESEN								
	National Australia Bank Ltd., Series G	5.00%	12/14/2021		2,000		2,067,784	0.1
REITS								
	Vanke Real Estate Hong Kong Co., Ltd.	3.85%	06/13/2022		10,000		10,112,500	0.8
							12,180,284	0.9
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN								
SÜDKOREA								
	Korea Expressway Corp.	4.73%	03/28/2021		10,000		9,878,125	0.8
							38,986,378	3.0
Gesamtanlagen								
	(Kosten ¥1,160,041,063)					¥	1,182,890,094	90.9%
Termineinlagen								
	DBS Bank Ltd, Singapore(b)	0.01 %	–				7,647,704	0.6
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten							110,067,823	8.5
Nettovermögen						¥	1,300,605,621	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte		Ursprünglicher Wert		Marktwert		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long								
Korea 3 Yr Bond Futures	06/16/2020	101	¥	64,715,258	¥	65,474,210	¥	758,952
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2020	40		39,742,646		39,819,713		77,067
Short								
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2020	16		25,086,251		24,972,776		113,475
							¥	949,494

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citibank, NA	USD	5,400	CNH	38,511	07/08/2020	¥ (236,041)
Goldman Sachs Bank USA	USD	14,500	CNH	103,004	06/03/2020	(803,555)
Goldman Sachs Bank USA	USD	11,500	CNH	81,790	06/08/2020	(568,336)
HSBC Bank USA	USD	6,962	CNH	49,156	06/11/2020	(715,497)
HSBC Bank USA	USD	49,156	CNY	49,140	06/11/2020	84,595
HSBC Bank USA	USD	5,000	CNH	36,039	07/08/2020	162,099
Royal Bank of Canada	USD	8,000	CNH	56,694	06/17/2020	(632,616)
Standard Chartered Bank	USD	14,000	CNH	99,442	06/22/2020	(912,107)
Standard Chartered Bank	CNH	530,721	USD	74,700	07/02/2020	5,085,417
Standard Chartered Bank	USD	83,000	CNH	589,117	07/02/2020	(6,223,164)
						¥ (4,759,205)
					Wertsteigerung	¥ 5,332,111
					Wertminderung	¥ (10,091,316)

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Republic of Indonesia	12/20/2024	USD 15,000	¥ 2,298,523	¥ (2,404,948)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

			Zinsart		
Clearing-Broker/(Börse)	Nominal-betrag (000)	Abschluss-datum	Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 8,124	11/09/2025	2.108%	3 Month LIBOR	¥ (5,438,499)
Swaps insgesamt					¥ (7,843,447)

(a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY – Chinese Yuan Renminbi
USD – United States Dollar

Glossar:

CBT – Chicago Board of Trade
CME – Chicago Mercantile Exchange
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
LIBOR – London Interbank Offered Rate

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Alcoa Nederland Holding BV	6.75%	09/30/2024	USD	1,705	$ 1,751,857	0.2%
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025		1,311	1,359,532	0.1
Ashland LLC	4.75%	08/15/2022		496	516,799	0.1
Berry Global, Inc.	5.13%	07/15/2023		2,409	2,448,274	0.3
Berry Global, Inc.	5.50%	05/15/2022		2,147	2,147,656	0.2
CF Industries, Inc.	3.45%	06/01/2023		5,272	5,314,934	0.5
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026		114	103,999	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025		1,700	1,770,678	0.2
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.75%	05/15/2022		3,468	3,522,252	0.4
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	5.13%	05/15/2024		2,232	2,323,580	0.2
Freeport-McMoRan, Inc.	3.55%	03/01/2022		338	343,304	0.0
Freeport-McMoRan, Inc.	3.88%	03/15/2023		2,911	2,933,444	0.3
Graphic Packaging International LLC	4.75%	04/15/2021		562	570,999	0.1
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.	7.38%	12/15/2023		2,006	2,008,403	0.2
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	11.00%	05/15/2022		2,604	2,583,554	0.3
Kaiser Aluminum Corp.	6.50%	05/01/2025		884	906,247	0.1
NOVA Chemicals Corp.	4.88%	06/01/2024		3,700	3,413,115	0.3
OCI NV	5.25%	11/01/2024		2,931	2,871,400	0.3
OCI NV	6.63%	04/15/2023		295	305,887	0.0
Olin Corp.	5.13%	09/15/2027		1,535	1,377,369	0.1
Olin Corp.	9.50%	06/01/2025		24	26,193	0.0
Peabody Energy Corp.	6.00%	03/31/2022		4,729	3,246,502	0.3
PolyOne Corp.	5.75%	05/15/2025		760	796,376	0.1
Reynolds Group Issuer, Inc./Reynolds Group Issuer LLC/ Reynolds Group Issuer Lu	5.13%	07/15/2023		6,350	6,416,620	0.6
Sealed Air Corp.	5.50%	09/15/2025		5,731	6,239,300	0.6
Smurfit Kappa Acquisitions ULC	2.88%	01/15/2026	EUR	1,631	1,872,192	0.2
SPCM SA	4.88%	09/15/2025	USD	2,290	2,357,280	0.2
thyssenkrupp AG	2.88%	02/22/2024	EUR	950	991,433	0.1
United States Steel Corp.	12.00%	06/01/2025	USD	2,007	2,013,062	0.2
WR Grace & Co.-Conn	5.13%	10/01/2021		6,511	6,692,024	0.7
					69,224,265	6.9
INVESTITIONSGÜTER						
Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026		4,543	4,554,765	0.5
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.25%	09/15/2022		3,000	3,031,860	0.3
Ball Corp.	5.00%	03/15/2022		1,052	1,098,493	0.1
Bombardier, Inc.	5.75%	03/15/2022		909	604,361	0.1
Bombardier, Inc.	6.00%	10/15/2022		42	27,379	0.0
Bombardier, Inc.	6.13%	01/15/2023		4,286	2,628,959	0.3
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025		40	24,301	0.0
Colfax Corp.	6.00%	02/15/2024		1,138	1,191,882	0.1
Crown European Holdings SA	2.25%	02/01/2023	EUR	1,175	1,294,696	0.1
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	USD	970	710,519	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026		3,647	3,555,825	0.4
Griffon Corp.	5.25%	03/01/2022		319	312,624	0.0
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	5.50%	04/15/2024		2,550	2,548,007	0.3
Owens-Brockway Glass Container, Inc.	5.00%	01/15/2022		372	375,365	0.0
RBS Global, Inc./Rexnord LLC.	4.88%	12/15/2025		3,485	3,485,213	0.3
Signature Aviation US Holdings, Inc.	5.38%	05/01/2026		4,095	3,894,012	0.4
Silgan Holdings, Inc.	2.25%	06/01/2028	EUR	1,352	1,467,020	0.1
SPX FLOW, Inc.	5.88%	08/15/2026	USD	2,453	2,478,160	0.2
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026		3,000	3,102,709	0.3
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	6.13%	07/15/2023		1,898	1,905,935	0.2
Terex Corp.	5.63%	02/01/2025		4,340	4,036,785	0.4
Tervita Corp.	7.63%	12/01/2021		4,848	3,741,008	0.4
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024		2,350	2,014,093	0.2
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	EUR	343	373,312	0.0
Trivium Packaging Finance BV	5.50%	08/15/2026	USD	558	585,626	0.1
					49,042,909	4.9
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Altice Financing SA	2.25%	01/15/2025	EUR	546	579,269	0.1
AMC Networks, Inc.	4.75%	12/15/2022	USD	3,323	3,326,688	0.3
AMC Networks, Inc.	5.00%	04/01/2024		1,807	1,827,158	0.2
Banijay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025	EUR	353	377,017	0.0
Banijay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	USD	2,145	2,123,371	0.2
Cablevision Systems Corp.	5.88%	09/15/2022		990	1,045,000	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.00%	03/01/2023		4,720	4,767,642	0.5
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.50%	05/01/2026		1,456	1,537,876	0.2
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027		574	574,000	0.1
CSC Holdings LLC	6.75%	11/15/2021		1,701	1,792,169	0.2

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
CSC Holdings LLC	10.88%	10/15/2025	USD	895	$ 969,216	0.1%
Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co.	5.38%	08/15/2026		1,499	1,189,947	0.1
DISH DBS Corp.	5.00%	03/15/2023		976	972,359	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	07/15/2022		307	315,456	0.0
DISH DBS Corp.	6.75%	06/01/2021		1,136	1,159,150	0.1
Gray Television, Inc.	5.13%	10/15/2024		1,500	1,521,754	0.2
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026		2,410	2,530,759	0.3
Lamar Media Corp.	3.75%	02/15/2028		1,850	1,794,821	0.2
Lamar Media Corp.	5.00%	05/01/2023		1,921	1,933,096	0.2
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027		2,345	2,444,359	0.2
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026		4,375	4,051,180	0.4
Netflix, Inc.	5.50%	02/15/2022		4,838	5,071,061	0.5
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	5.63%	02/15/2024		2,200	2,221,955	0.2
RR Donnelley & Sons Co.	7.88%	03/15/2021		411	409,252	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	5.13%	02/15/2027		2,140	2,002,186	0.2
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	08/01/2022		3,629	3,637,703	0.4
Sirius XM Radio, Inc.	4.63%	05/15/2023		1,333	1,338,852	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	4.63%	07/15/2024		488	499,547	0.0
TEGNA, Inc.	4.88%	09/15/2021		5,591	5,596,193	0.6
Univision Communications, Inc.	5.13%	05/15/2023		1,981	1,927,760	0.2
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025		265	253,140	0.0
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025		435	467,142	0.0
Virgin Media Finance PLC	6.00%	10/15/2024		650	669,059	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	08/15/2026		5,662	5,870,104	0.6
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027		1,206	1,274,609	0.1
					68,070,850	6.8
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026		4,379	4,644,084	0.5
C&W Senior Financing DAC	7.50%	10/15/2026		3,802	3,885,842	0.4
CenturyLink, Inc., Series S	6.45%	06/15/2021		4,443	4,587,989	0.4
CenturyLink, Inc., Series T	5.80%	03/15/2022		2,161	2,248,392	0.2
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026		3,220	3,107,300	0.3
Hughes Satellite Systems Corp.	5.25%	08/01/2026		987	1,021,784	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	7.63%	06/15/2021		860	899,574	0.1
Intelsat Jackson Holdings SA.	9.50%	09/30/2022		3,629	4,080,868	0.4
Level 3 Financing, Inc.	5.13%	05/01/2023		1,158	1,158,185	0.1
Level 3 Financing, Inc.	5.38%	08/15/2022		1,977	1,979,794	0.2
Sprint Communications, Inc.	6.00%	11/15/2022		572	609,197	0.1
Sprint Corp.	7.25%	09/15/2021		995	1,045,783	0.1
Sprint Corp.	7.88%	09/15/2023		299	338,888	0.0
T-Mobile USA, Inc.	4.00%	04/15/2022		1,979	2,035,776	0.2
T-Mobile USA, Inc.	6.50%	01/15/2024		2,138	2,189,470	0.2
Telecom Italia SpA/Milano	5.30%	05/30/2024		490	514,625	0.1
Telecom Italia SpA/Milano	5.88%	05/19/2023	GBP	700	927,905	0.1
Zayo Group Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2027	USD	1,032	1,015,534	0.1
					36,290,990	3.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025		1,430	1,533,870	0.2
Allison Transmission, Inc.	4.75%	10/01/2027		1,010	988,440	0.1
Allison Transmission, Inc.	5.00%	10/01/2024		3,400	3,441,764	0.3
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	04/01/2025		2,711	2,580,424	0.3
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027		385	359,991	0.0
Dana, Inc.	5.50%	12/15/2024		3,550	3,551,472	0.4
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023		1,365	1,416,604	0.1
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025		403	423,250	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.09%	01/09/2023		400	377,179	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.10%	05/04/2023		400	373,384	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.22%	01/09/2022		869	835,138	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	4.06%	11/01/2024		495	466,768	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	4.14%	02/15/2023		1,200	1,162,406	0.1
Garrett LX I SARL/Garrett Borrowing LLC	5.13%	10/15/2026	EUR	1,109	814,000	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	3.63%	05/15/2025		915	992,364	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.00%	05/15/2027	USD	1,240	1,193,476	0.1
Meritor, Inc.	6.25%	02/15/2024		3,555	3,572,079	0.4
Navistar International Corp.	9.50%	05/01/2025		1,527	1,653,316	0.2
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	4.38%	05/15/2026	EUR	2,536	2,732,162	0.3
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	6.25%	05/15/2026	USD	2,459	2,519,660	0.2
Tenneco, Inc.	4.88%	04/15/2022	EUR	1,700	1,557,040	0.2
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2024		995	860,708	0.1
Titan International, Inc.	6.50%	11/30/2023	USD	1,457	798,558	0.1
ZF North America Capital, Inc.	4.50%	04/29/2022		3,475	3,430,928	0.3
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025		1,700	1,657,777	0.2
					39,292,758	3.9

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG							
Carnival Corp.	1.88%	11/07/2022	EUR	3,465	$	2,966,666	0.3%
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op	5.38%	04/15/2027	USD	1,010		962,445	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op	5.50%	05/01/2025		2,412		2,462,430	0.2
NCL Corp., Ltd.	3.63%	12/15/2024		6,921		4,161,766	0.4
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025		932		957,447	0.1
Six Flags Entertainment Corp.	4.88%	07/31/2024		1,650		1,553,987	0.2
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025		601		634,655	0.1
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025		912		960,671	0.1
						14,660,067	1.5
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE							
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025		2,176		2,001,267	0.2
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US Corp.	6.25%	09/15/2027		3,800		3,617,448	0.3
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025		4,400		4,313,687	0.4
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025		688		703,845	0.1
Hilton Grand Vacations Borrower LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower, Inc.	6.13%	12/01/2024		2,800		2,699,448	0.3
International Game Technology PLC	6.25%	02/15/2022		2,175		2,219,273	0.2
International Game Technology PLC	6.50%	02/15/2025		275		282,823	0.0
KB Home	7.00%	12/15/2021		496		520,698	0.1
KB Home	7.50%	09/15/2022		1,059		1,156,823	0.1
KB Home	7.63%	05/15/2023		840		922,047	0.1
Lennar Corp.	4.13%	01/15/2022		722		735,876	0.1
Lennar Corp.	6.25%	12/15/2021		1,170		1,206,791	0.1
Lennar Corp.	8.38%	01/15/2021		1,573		1,624,237	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025		723		748,538	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC	6.50%	09/15/2026		3,315		3,294,699	0.3
Mattamy Group Corp.	5.25%	12/15/2027		1,045		1,005,662	0.1
MGM Resorts International	6.00%	03/15/2023		707		710,190	0.1
MGM Resorts International	7.75%	03/15/2022		865		894,903	0.1
PulteGroup, Inc.	5.00%	01/15/2027		3,673		3,933,404	0.4
PulteGroup, Inc.	5.50%	03/01/2026		1,694		1,871,519	0.2
Samsonite Finco SARL	3.50%	05/15/2026	EUR	272		240,240	0.0
Scientific Games International, Inc.	5.00%	10/15/2025	USD	1,501		1,403,142	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028		2,155		2,000,111	0.2
Standard Industries, Inc./NJ	5.38%	11/15/2024		3,657		3,730,989	0.4
Standard Industries, Inc./NJ	5.50%	02/15/2023		582		590,696	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027		1,670		1,664,740	0.2
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.88%	04/15/2023		235		234,413	0.0
Toll Brothers Finance Corp.	4.38%	04/15/2023		5,176		5,276,676	0.5
Wyndham Destinations, Inc.	3.90%	03/01/2023		4,000		3,702,729	0.4
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025		4,320		4,191,661	0.4
						57,498,575	5.7
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS							
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	3.88%	01/15/2028		1,134		1,120,305	0.1
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	5.00%	10/15/2025		1,429		1,446,746	0.1
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	5.75%	04/15/2025		871		925,554	0.1
IRB Holding Corp.	7.00%	06/15/2025		1,761		1,825,247	0.2
KFC Holding Co./Pizza Hut Holdings LLC/ Taco Bell of America LLC	5.25%	06/01/2026		1,013		1,053,022	0.1
Yum! Brands, Inc.	7.75%	04/01/2025		1,408		1,558,240	0.2
						7,929,114	0.8
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER							
Asbury Automotive Group, Inc.	4.50%	03/01/2028		493		470,193	0.0
Burlington Coat Factory Warehouse Corp.	6.25%	04/15/2025		900		934,037	0.1
Dufry One BV	2.50%	10/15/2024	EUR	1,053		1,011,084	0.1
Group 1 Automotive, Inc.	5.00%	06/01/2022	USD	6,674		6,577,271	0.6
Hanesbrands, Inc.	4.63%	05/15/2024		3,545		3,620,971	0.3
L Brands, Inc.	5.63%	02/15/2022		1,411		1,370,585	0.1
Levi Strauss & Co.	5.00%	05/01/2025		3,644		3,718,375	0.4
Penske Automotive Group, Inc.	5.50%	05/15/2026		723		714,791	0.1
Penske Automotive Group, Inc.	5.75%	10/01/2022		4,981		4,996,471	0.5
PetSmart, Inc.	5.88%	06/01/2025		2,200		2,215,035	0.2
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026		3,128		2,737,658	0.3
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024		641		609,194	0.1
William Carter Co. (The)	5.50%	05/15/2025		533		550,060	0.1
William Carter Co. (The)	5.63%	03/15/2027		2,715		2,781,533	0.3
						32,307,258	3.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Acadia Healthcare Co., Inc.	5.63%	02/15/2023	USD	2,027	$ 2,028,686	0.2%
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	3.50%	02/15/2023		2,514	2,522,941	0.2
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.63%	01/15/2027		1,428	1,452,045	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	5.75%	03/15/2025		1,267	1,306,334	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	6.63%	06/15/2024		1,129	1,168,437	0.1
Avantor, Inc.	9.00%	10/01/2025		979	1,057,365	0.1
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	EUR	497	543,144	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.63%	02/15/2025	USD	1,290	1,241,856	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	8.63%	01/15/2024		1,150	1,159,109	0.1
DaVita, Inc.	5.00%	05/01/2025		2,452	2,515,144	0.2
DaVita, Inc.	5.13%	07/15/2024		195	198,921	0.0
HCA, Inc.	5.88%	02/15/2026		2,278	2,552,693	0.3
IQVIA, Inc.	3.25%	03/15/2025	EUR	934	1,049,701	0.1
IQVIA, Inc.	5.00%	10/15/2026	USD	1,373	1,451,753	0.1
LifePoint Health, Inc.	4.38%	02/15/2027		4,930	4,783,986	0.5
LifePoint Health, Inc.	6.75%	04/15/2025		610	652,151	0.1
MEDNAX, Inc.	5.25%	12/01/2023		1,946	1,909,481	0.2
MEDNAX, Inc.	6.25%	01/15/2027		1,734	1,636,472	0.2
Newell Brands, Inc.	4.20%	04/01/2026		2,115	2,191,038	0.2
Par Pharmaceutical, Inc.	7.50%	04/01/2027		663	677,831	0.1
Spectrum Brands, Inc.	5.75%	07/15/2025		2,906	2,988,384	0.3
Tenet Healthcare Corp.	4.63%	09/01/2024		605	611,735	0.1
Tenet Healthcare Corp.	4.88%	01/01/2026		4,432	4,551,959	0.5
					40,251,166	4.0
ENERGIE						
Antero Resources Corp.	5.13%	12/01/2022		3,853	2,757,326	0.3
Callon Petroleum, Co.	6.25%	04/15/2023		1,390	455,683	0.1
Cenovus Energy, Inc.	3.80%	09/15/2023		325	310,269	0.0
Cenovus Energy, Inc.	4.25%	04/15/2027		1,515	1,375,619	0.1
CITGO Petroleum Corp.	6.25%	08/15/2022		3,687	3,631,695	0.4
DCP Midstream Operating LP	4.95%	04/01/2022		4,441	4,321,160	0.4
EnLink Midstream Partners LP	4.15%	06/01/2025		1,329	1,069,649	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024		321	263,047	0.0
EnLink Midstream Partners LP	4.85%	07/15/2026		3,721	2,991,509	0.3
EQM Midstream Partners LP	5.50%	07/15/2028		964	891,713	0.1
EQT Corp.	3.00%	10/01/2022		430	417,136	0.0
EQT Corp.	6.13%	02/01/2025		456	464,813	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024		543	496,993	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028		1,646	1,537,541	0.2
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	06/15/2023		2,292	2,168,908	0.2
Hess Midstream Operations LP	5.63%	02/15/2026		962	932,804	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.00%	12/01/2024		2,581	2,304,137	0.2
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026		2,310	1,316,304	0.1
Nabors Industries, Inc.	5.75%	02/01/2025		750	232,500	0.0
Neptune Energy Bondco PLC	6.63%	05/15/2025		287	251,808	0.0
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023		4,175	3,247,747	0.3
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023		1,097	944,105	0.1
Occidental Petroleum Corp.	2.90%	08/15/2024		1,485	1,175,233	0.1
Occidental Petroleum Corp.	3.20%	08/15/2026		232	169,330	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	9.25%	05/15/2025		2,284	2,472,817	0.3
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026		1,126	1,040,008	0.1
QEP Resources, Inc.	5.25%	05/01/2023		1,695	904,004	0.1
QEP Resources, Inc.	5.38%	10/01/2022		2,147	1,221,935	0.1
Range Resources Corp.	5.00%	08/15/2022		675	631,822	0.1
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023		908	820,641	0.1
Range Resources Corp.	5.88%	07/01/2022		51	48,233	0.0
SM Energy Co.	6.13%	11/15/2022		2,315	1,411,740	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	4.88%	01/15/2023		6,224	6,324,560	0.6
Targa Resources Partners LP/ Targa Resources Partners Finance Corp.	4.25%	11/15/2023		1,960	1,918,506	0.2
Transocean Phoenix 2 Ltd.	7.75%	10/15/2024		1,544	1,497,672	0.2
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027		1,040	935,754	0.1
Transocean Sentry Ltd.	5.38%	05/15/2023		1,377	1,278,160	0.1
Weatherford International Ltd.	11.00%	12/01/2024		393	265,551	0.0
Western Midstream Operating LP	3.10%	02/01/2025		956	888,855	0.1
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022		495	486,139	0.1
WPX Energy, Inc.	4.50%	01/15/2030		3,385	3,104,393	0.3
					58,977,819	5.9

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	5.88%	05/15/2026	USD	964	$ 997,540	0.1%
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025		4,804	4,553,269	0.5
Laureate Education, Inc.	8.25%	05/01/2025		1,839	1,942,800	0.2
					7,493,609	0.8
DIENSTLEISTUNGEN						
ADT Security Corp. (The)	6.25%	10/15/2021		2,443	2,530,291	0.3
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026		5,644	5,962,365	0.6
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027		457	430,440	0.0
APX Group, Inc.	7.88%	12/01/2022		2,449	2,559,205	0.3
Aramark Services, Inc.	4.75%	06/01/2026		2,480	2,447,522	0.2
Aramark Services, Inc.	5.00%	04/01/2025		3,298	3,315,843	0.3
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023	EUR	984	893,634	0.1
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	USD	2,690	2,710,211	0.3
Intertrust Group BV	3.38%	11/15/2025	EUR	2,861	3,172,428	0.3
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027	USD	939	859,185	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	4.50%	10/01/2020		3,205	3,204,717	0.3
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.00%	04/15/2022		2,121	2,117,762	0.2
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024		4,337	4,520,017	0.5
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026		720	748,775	0.1
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025		406	418,144	0.0
Sabre GLBL, Inc.	5.25%	11/15/2023		2,598	2,467,145	0.3
Sabre GLBL, Inc.	5.38%	04/15/2023		1,437	1,357,766	0.1
Sabre GLBL, Inc.	9.25%	04/15/2025		233	249,995	0.0
					39,965,445	4.0
TECHNOLOGIE						
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025		1,010	1,066,886	0.1
CDK Global, Inc.	5.00%	10/15/2024		2,375	2,538,896	0.3
CDW LLC/CDW Finance Corp.	4.13%	05/01/2025		2,018	2,071,060	0.2
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024		3,416	3,508,422	0.3
Dell International LLC/EMC Corp.	5.88%	06/15/2021		1,481	1,481,872	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	7.13%	06/15/2024		2,521	2,618,806	0.3
Ingram Micro, Inc.	5.45%	12/15/2024		450	432,021	0.0
Microchip Technology, Inc.	4.25%	09/01/2025		1,565	1,574,271	0.2
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027		1,099	1,097,272	0.1
NCR Corp.	8.13%	04/15/2025		709	762,263	0.1
Nokia Oyj	3.38%	06/12/2022		2,805	2,854,149	0.3
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	02/01/2023		2,383	2,326,141	0.2
Western Digital Corp.	4.75%	02/15/2026		5,714	6,020,449	0.6
Xerox Corp.	4.07%	03/17/2022		2,049	2,028,513	0.2
Xerox Corp.	4.13%	03/15/2023		1,992	1,965,909	0.2
					32,346,930	3.2
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Algeco Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023		2,921	2,720,438	0.3
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027		254	194,664	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	10.50%	05/15/2025		955	1,062,619	0.1
Europcar Mobility Group	4.00%	04/30/2026	EUR	1,276	848,956	0.1
Hertz Corp. (The)	5.50%	10/15/2024	USD	954	160,587	0.0
Hertz Corp. (The)	6.25%	10/15/2022		630	106,464	0.0
Loxam SAS	3.50%	04/15/2022	EUR	389	423,301	0.1
United Rentals North America, Inc.	5.50%	07/15/2025	USD	583	603,301	0.1
XPO Logistics, Inc.	6.13%	09/01/2023		5,339	5,421,884	0.5
XPO Logistics, Inc.	6.75%	08/15/2024		385	403,900	0.0
					11,946,114	1.2
					565,297,869	56.4
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
ABN AMRO Bank NV(b)	5.75%	09/22/2020	EUR	1,600	1,736,546	0.2
Alliance Data Systems Corp.	4.75%	12/15/2024	USD	5,078	4,544,080	0.4
Ally Financial, Inc.	5.75%	11/20/2025		2,860	3,002,677	0.3
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(b)	5.88%	05/24/2022	EUR	1,600	1,718,371	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(b)	5.88%	09/24/2023		600	640,143	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(b)	8.88%	04/14/2021		1,000	1,154,540	0.1
Banco Santander SA(b)	6.75%	04/25/2022		2,800	3,168,804	0.3
CIT Group, Inc.	5.00%	08/15/2022	USD	1,986	1,993,225	0.2
CIT Group, Inc.	5.00%	08/01/2023		945	950,773	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024		3,471	3,474,876	0.3
Royal Bank of Scotland Group PLC(b)	8.63%	08/15/2021		2,530	2,634,418	0.3
Royal Bank of Scotland Group PLC, Series U(b) (c)	3.77%	09/30/2027		3,300	2,983,797	0.3
Societe Generale SA(b)	8.00%	09/29/2025		1,975	2,122,405	0.2
UniCredit SpA(b)	9.25%	06/03/2022	EUR	2,539	3,055,284	0.3
					33,179,939	3.3

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
MAKLER						
LPL Holdings, Inc.	4.63%	11/15/2027	USD	510	$ 500,385	0.0%
LPL Holdings, Inc.	5.75%	09/15/2025		4,652	4,853,460	0.5
NFP Corp.	7.00%	05/15/2025		493	510,846	0.1
					5,864,691	0.6
FINANZEN						
goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024		4,781	4,500,972	0.4
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	6.25%	06/03/2026		575	520,800	0.1
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR	3,074	3,101,863	0.3
Navient Corp.	5.50%	01/25/2023	USD	4,409	4,200,272	0.4
Navient Corp.	6.50%	06/15/2022		455	447,060	0.0
Navient Corp.	7.25%	09/25/2023		914	882,554	0.1
SLM Corp.	5.13%	04/05/2022		1,802	1,775,663	0.2
					15,429,184	1.5
VERSICHERUNGEN						
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	8.13%	02/15/2024		4,217	4,487,767	0.5
Centene Corp.	4.75%	01/15/2025		3,095	3,185,491	0.3
Centene Corp.	5.38%	08/15/2026		1,889	2,004,752	0.2
					9,678,010	1.0
SONSTIGE FINANZWERTE						
Intrum AB	2.75%	07/15/2022	EUR	1,165	1,202,168	0.1
Intrum AB	3.50%	07/15/2026		682	648,002	0.1
					1,850,170	0.2
REITS						
Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	USD	3,471	3,530,354	0.4
Iron Mountain, Inc.	4.38%	06/01/2021		1,062	1,061,846	0.1
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2027		205	205,440	0.0
Iron Mountain, Inc.	6.00%	08/15/2023		3,864	3,917,998	0.4
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.63%	05/01/2024		4,977	5,199,404	0.5
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.25%	08/01/2026		960	994,290	0.1
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	6.38%	03/01/2024		2,100	2,156,068	0.2
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	4.88%	06/01/2023		3,294	2,930,324	0.3
SBA Communications Corp.	4.00%	10/01/2022		1,797	1,820,894	0.2
Service Properties Trust	4.35%	10/01/2024		5,000	4,400,000	0.4
VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	3.50%	02/15/2025		3,177	3,076,827	0.3
					29,293,445	2.9
					95,295,439	9.5
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
AES Corp./VA	4.88%	05/15/2023		4,558	4,586,170	0.5
Calpine Corp.	5.25%	06/01/2026		2,088	2,165,228	0.2
Calpine Corp.	5.50%	02/01/2024		917	925,613	0.1
Calpine Corp.	5.75%	01/15/2025		1,995	2,041,015	0.2
NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027		4,017	4,289,545	0.4
Orano SA	4.88%	09/23/2024	EUR	1,150	1,380,432	0.2
Vistra Operations Co. LLC	5.50%	09/01/2026	USD	3,937	4,141,646	0.4
					19,529,649	2.0
					680,122,957	67.9
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Anglo American Capital PLC	3.63%	09/11/2024		4,336	4,442,829	0.4
Equate Petrochemical BV	3.00%	03/03/2022		2,105	2,099,737	0.2
Glencore Finance Canada Ltd.	4.25%	10/25/2022		1,977	2,075,768	0.2
Glencore Finance Europe Ltd.	1.88%	09/13/2023		910	1,011,976	0.1
Glencore Funding LLC	4.13%	05/30/2023		950	1,001,430	0.1
Huntsman International LLC	5.13%	11/15/2022		2,635	2,720,297	0.3
					13,352,037	1.3
INVESTITIONSGÜTER						
Rolls-Royce PLC	2.13%	06/18/2021		3,494	3,793,620	0.4
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Time Warner Cable LLC	4.00%	09/01/2021		2,643	2,706,423	0.2
Walt Disney Co. (The)	4.00%	10/01/2023		542	590,723	0.1
					3,297,146	0.3
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025		4,813	5,105,900	0.5
CONSUMER CYCLICAL - AUTOMOTIVE						
General Motors Co.	4.00%	04/01/2025		123	124,189	0.0
General Motors Co.	4.88%	10/02/2023		251	259,489	0.0

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
General Motors Financial Co., Inc.	2.20%	04/01/2024	EUR	946	$ 1,021,147	0.1%
General Motors Financial Co., Inc.	3.25%	01/05/2023	USD	490	487,241	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	3.70%	05/09/2023		502	500,922	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	4.00%	10/06/2026		38	37,854	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.25%	05/15/2023		304	308,040	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.30%	07/13/2025		118	119,511	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.10%	01/17/2024		2,449	2,545,253	0.3
General Motors Financial Co., Inc.	5.25%	03/01/2026		159	166,612	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029		415	449,926	0.0
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.88%	05/19/2023	EUR	2,600	2,959,349	0.3
Volkswagen International Finance NV, Series 4Y	0.50%	03/30/2021		3,700	4,084,258	0.4
					13,063,791	1.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG						
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023	USD	1,448	1,539,344	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023		1,445	1,506,413	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025		2,877	3,035,235	0.3
Silversea Cruise Finance Ltd.	7.25%	02/01/2025		1,005	952,822	0.1
					7,033,814	0.7
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Marriott International, Inc./MD	5.75%	05/01/2025		460	498,223	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Fresenius Medical Care US Finance II, Inc.	4.13%	10/15/2020		2,858	2,858,800	0.3
General Mills, Inc.	2.10%	11/16/2020	EUR	2,410	2,683,967	0.3
Imperial Brands Finance PLC	3.50%	07/26/2026	USD	1,207	1,225,782	0.1
Sysco Corp.	5.65%	04/01/2025		1,000	1,141,843	0.1
Tesco PLC	6.13%	02/24/2022	GBP	222	295,514	0.0
Universal Health Services, Inc.	4.75%	08/01/2022	USD	2,122	2,126,737	0.2
					10,332,643	1.0
ENERGIE						
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	7.00%	06/30/2024		3,728	4,160,990	0.4
Energy Transfer Operating LP	4.25%	03/15/2023		2,117	2,186,886	0.2
Marathon Petroleum Corp.	4.50%	05/01/2023		632	673,895	0.1
Marathon Petroleum Corp.	4.70%	05/01/2025		546	603,663	0.1
Marathon Petroleum Corp.	4.75%	12/15/2023		2,019	2,188,244	0.2
Newfield Exploration Co.	5.75%	01/30/2022		2,078	2,004,852	0.2
ONEOK, Inc.	2.20%	09/15/2025		809	770,044	0.1
ONEOK, Inc.	2.75%	09/01/2024		836	825,515	0.1
ONEOK, Inc.	5.85%	01/15/2026		1,188	1,310,886	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.60%	11/01/2024		1,829	1,830,572	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026		510	518,393	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.65%	10/15/2025		745	761,226	0.1
Southern Star Central Corp.	5.13%	07/15/2022		4,419	4,414,914	0.4
Sunoco Logistics Partners Operations LP	3.90%	07/15/2026		1,105	1,105,777	0.1
Williams Cos., Inc. (The)	3.35%	08/15/2022		3,959	4,080,054	0.4
Williams Cos., Inc. (The)	3.70%	01/15/2023		1,362	1,428,193	0.1
					28,864,104	2.9
DIENSTLEISTUNGEN						
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025		950	1,014,846	0.1
Expedia Group, Inc.	7.00%	05/01/2025		1,723	1,842,542	0.2
					2,857,388	0.3
TECHNOLOGIE						
Dell International LLC/EMC Corp.	6.02%	06/15/2026		596	674,327	0.1
Micron Technology, Inc.	4.98%	02/06/2026		499	560,041	0.1
NXP BV/NXP Funding LLC	4.63%	06/01/2023		2,302	2,470,156	0.2
Seagate HDD Cayman	4.88%	03/01/2024		2,440	2,579,868	0.2
					6,284,392	0.6
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN						
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025		2,530	2,618,474	0.3
Southwest Airlines Co.	4.75%	05/04/2023		1,351	1,370,783	0.1
Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025		1,405	1,427,589	0.2
					5,416,846	0.6
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022		1,025	860,609	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027		300	207,087	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023		954	760,042	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024		1,425	1,142,866	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025		52	37,529	0.0
					3,008,133	0.3
					102,908,037	10.3

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
ABN AMRO Bank NV, Series E	6.25%	04/27/2022	USD	1,093	$ 1,177,284	0.1%
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025		2,292	2,381,652	0.2
AIB Group PLC	4.75%	10/12/2023		1,083	1,140,206	0.1
Ally Financial, Inc.	4.13%	02/13/2022		869	888,858	0.1
BNP Paribas SA(b)	6.75%	03/14/2022		200	205,664	0.0
BNP Paribas SA(b)	7.63%	03/30/2021		1,665	1,711,470	0.2
Capital One Bank USA NA	3.38%	02/15/2023		2,167	2,236,030	0.2
Citigroup Capital XVIII(c)	1.44%	06/28/2067	GBP	4,306	4,912,851	0.5
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	1.25%	04/14/2022	EUR	4,237	4,733,009	0.5
HSBC Holdings PLC(b)	5.25%	09/16/2022		3,220	3,553,847	0.4
Lloyds Banking Group PLC(b)	7.63%	06/27/2023	GBP	1,940	2,418,968	0.2
Mizuho Financial Group, Inc.(c)	1.91%	09/13/2021	USD	2,779	2,787,095	0.3
Morgan Stanley	5.00%	11/24/2025		817	941,294	0.1
Royal Bank of Scotland Group PLC	2.00%	03/04/2025	EUR	1,080	1,217,036	0.1
Santander Holdings USA, Inc.	3.24%	10/05/2026	USD	605	607,684	0.1
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027		1,048	1,104,885	0.1
Standard Chartered PLC	5.20%	01/26/2024		1,913	2,046,441	0.2
					34,064,274	3.4
FINANZEN						
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	2.88%	08/14/2024		186	155,518	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023		150	132,905	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.65%	07/21/2027		1,089	900,059	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028		631	526,118	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.13%	07/03/2023		194	172,158	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	10/01/2025		474	406,391	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.88%	01/16/2024		1,052	938,511	0.1
Park Aerospace Holdings Ltd.	5.25%	08/15/2022		2,750	2,423,772	0.3
					5,655,432	0.6
REITS						
Digital Euro Finco LLC	2.50%	01/16/2026	EUR	1,594	1,883,079	0.2
EPR Properties	5.25%	07/15/2023	USD	2,240	2,056,629	0.2
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	3.35%	09/01/2024		1,819	1,691,683	0.2
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025		689	692,431	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	11/01/2023		3,785	3,804,552	0.4
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026		263	264,392	0.0
Healthpeak Properties, Inc.	4.20%	03/01/2024		279	293,084	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.	4.38%	08/01/2023		1,542	1,551,671	0.1
Sabra Health Care LP.	4.80%	06/01/2024		2,000	1,963,229	0.2
Spirit Realty LP	4.45%	09/15/2026		1,335	1,278,122	0.1
					15,478,872	1.5
					55,198,578	5.5
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
Dominion Energy, Inc.	4.10%	04/01/2021		2,100	2,146,110	0.2
					160,252,725	16.0
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN						
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH						
Connecticut Avenue Securities Trust						
Series 2019-R05, Class 1M2(c)	2.17%	07/25/2039		816	801,326	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(c)	3.82%	02/25/2040		192	132,282	0.0
Eagle Re Ltd., Series 2019-1, Class M2(c)	3.47%	04/25/2029		374	303,586	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp Structured Agency Credit Risk Debt Notes						
Series 2013-DN2, Class M2(c)	4.42%	11/25/2023		182	141,868	0.0
Series 2014-DN3, Class M3(c)	4.17%	08/25/2024		172	174,357	0.0
Series 2016-DNA4, Class M3(c)	3.97%	03/25/2029		2,433	2,516,953	0.3
Series 2016-HQA3, Class M3(c)	4.02%	03/25/2029		636	647,612	0.1
Series 2016-HQA4, Class M3(c)	4.07%	04/25/2029		1,811	1,847,463	0.2
Series 2020-HQA2, Class M2(c)	3.27%	03/25/2050		106	88,477	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp.						
Series 2013-DN1, Class M2(c)	7.32%	07/25/2023		867	753,970	0.1
Series 2018-HQA2, Class M2(c)	2.47%	10/25/2048		2,103	1,939,173	0.2
Series 2019-DNA1, Class M2(c)	2.82%	01/25/2049		489	466,538	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes						
Series 2014-DN2, Class M3(c)	3.77%	04/25/2024		250	207,500	0.0
Series 2015-DN1, Class M3(c)	4.32%	01/25/2025		576	583,918	0.1
Series 2015-DNA1, Class M3(c)	3.47%	10/25/2027		250	254,146	0.0
Series 2015-DNA2, Class M3(c)	4.07%	12/25/2027		1,325	1,342,486	0.1
Series 2015-DNA3, Class M3(c)	4.87%	04/25/2028		600	625,391	0.1
Series 2015-HQA1, Class M3(c)	4.87%	03/25/2028		755	783,069	0.1

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Series 2016-DNA1, Class M3(c)	5.72%	07/25/2028	USD	241	$ 258,196	0.0%
Series 2016-DNA3, Class M3(c)	5.17%	12/25/2028		228	239,370	0.0
Series 2016-HQA2, Class M3(c)	5.32%	11/25/2028		1,214	1,250,568	0.1
Series 2017-DNA2, Class M2(c)	3.62%	10/25/2029		2,767	2,813,163	0.3
Series 2017-DNA3, Class M2(c)	2.67%	03/25/2030		2,428	2,428,428	0.2
Series 2017-HQA1, Class M2(c)	3.72%	08/25/2029		2,152	2,158,404	0.2
Series 2018-HQA1, Class M2(c)	2.47%	09/25/2030		154	143,842	0.0
Series 2019-DNA3, Class M2(c)	2.22%	07/25/2049		454	436,189	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities						
Series 2014-C04, Class 1M2(c)	5.07%	11/25/2024		882	910,361	0.1
Series 2015-C03, Class 2M2(c)	5.17%	07/25/2025		590	596,603	0.1
Series 2015-C04, Class 1M2(c)	5.87%	04/25/2028		277	291,987	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(c)	5.72%	04/25/2028		343	361,218	0.0
Series 2016-C01, Class 1M2(c)	6.92%	08/25/2028		2,131	2,252,020	0.2
Series 2016-C01, Class 2M2(c)	7.12%	08/25/2028		370	400,134	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(c)	6.17%	09/25/2028		729	762,025	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(c)	5.47%	10/25/2028		228	241,079	0.0
Series 2016-C03, Class 2M2(c)	6.07%	10/25/2028		843	891,723	0.1
Series 2016-C04, Class 1M2(c)	4.42%	01/25/2029		1,436	1,479,420	0.2
Series 2016-C05, Class 2M2(c)	4.62%	01/25/2029		661	680,595	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(c)	4.42%	04/25/2029		591	609,722	0.1
Series 2016-C07, Class 2M2(c)	4.52%	05/25/2029		528	541,342	0.1
Series 2017-C01, Class 1M2(c)	3.72%	07/25/2029		2,497	2,530,419	0.3
Series 2017-C02, Class 2M2(c)	3.82%	09/25/2029		238	238,342	0.0
Series 2017-C03, Class 1M2(c)	3.17%	10/25/2029		191	191,219	0.0
Series 2017-C05, Class 1M2(c)	2.37%	01/25/2030		231	223,280	0.0
Series 2018-C01, Class 1M1(c)	0.77%	07/25/2030		114	114,295	0.0
Series 2018-C04, Class 2M2(c)	2.72%	12/25/2030		306	294,084	0.0
Mortgage Insurance-Linked Notes, Series 2019-1, Class M2(c)	3.07%	11/26/2029		2,880	2,521,801	0.3
Oaktown Re III Ltd., Series 2019-1A, Class M2(c)	2.72%	07/25/2029		1,608	1,262,248	0.1
Radnor Re Ltd.						
Series 2018-1, Class M2(c)	2.87%	03/25/2028		150	133,167	0.0
Series 2019-1, Class M2(c)	3.37%	02/25/2029		1,205	989,687	0.1
STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class M2(c)	2.27%	09/25/2048		1,746	1,660,920	0.2
					43,515,966	4.3
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025		960	811,050	0.1
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023		370	315,425	0.0
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	04/01/2023		1,585	1,460,181	0.2
					2,586,656	0.3
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
MTN Mauritius Investments Ltd.	5.37%	02/13/2022		2,790	2,829,234	0.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024		491	489,625	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026		514	512,073	0.1
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024		3,399	3,361,823	0.3
					4,363,521	0.4
ENERGIE						
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR	150,000	1,886,995	0.2
Petrobras Global Finance BV	5.09%	01/15/2030	USD	1,495	1,430,067	0.1
Petrobras Global Finance BV	6.00%	01/27/2028		893	905,113	0.1
					4,222,175	0.4
					14,001,586	1.4
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
BBVA Bancomer SA/Texas	6.50%	03/10/2021		1,520	1,559,900	0.2
					15,561,486	1.6
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN						
KATAR						
Qatar Government International Bond	3.88%	04/23/2023		1,799	1,918,210	0.2
					1,918,210	0.2
SAUDI-ARABIEN						
Saudi Government International Bond	4.00%	04/17/2025		3,255	3,546,374	0.3
					3,546,374	0.3
					5,464,584	0.5
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
BRASILIEN						
Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F	10.00%	01/01/2021	BRL	5,870	1,147,203	0.1

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominican Republic International Bond	16.95%	02/04/2022	DOP	70,900	$ 1,369,765	0.1%
SÜDAFRIKA						
Republic of South Africa Government Bond, Series 2023	7.75%	02/28/2023	ZAR	12,994	786,591	0.1
					3,303,559	0.3
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS						
CLO – VARIABEL VERZINSLICH						
GoldenTree Loan Opportunities Ltd., Series 2014-9A, Class DR2(c)	3.84%	10/29/2029	USD	2,540	2,323,914	0.2
ABS-ANLEIHEN						
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS						
Wendy's Funding LLC, Series 2018-1A, Class A2I	3.57%	03/15/2048		1,902	1,853,899	0.2
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
RUSSLAND						
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6217	7.50%	08/18/2021	RUB	111,994	1,644,139	0.2
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE						
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominican Republic International Bond	7.50%	05/06/2021	USD	767	783,677	0.1
BANKDARLEHEN						
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
U.S. Renal Care, Inc.(c)	5.19%	06/26/2026		525	499,103	0.0
					915,326,009	91.3
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Axalta Coating Systems LLC	4.88%	08/15/2024		1,812	1,840,547	0.2
Berry Global, Inc.	6.00%	10/15/2022		698	703,633	0.1
Eldorado Gold Corp.	9.50%	06/01/2024		2,032	2,151,825	0.2
OCI NV	5.00%	04/15/2023	EUR	300	337,901	0.0
					5,033,906	0.5
INVESTITIONSGÜTER						
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	USD	2,308	2,206,976	0.2
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
CSC Holdings LLC	5.38%	07/15/2023		1,555	1,576,530	0.2
CSC Holdings LLC	6.63%	10/15/2025		610	636,688	0.1
Nexstar Broadcasting, Inc.	5.63%	08/01/2024		2,250	2,310,980	0.2
					4,524,198	0.5
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Eldorado Resorts, Inc.	6.00%	04/01/2025		1,137	1,163,494	0.1
Forestar Group, Inc.	5.00%	03/01/2028		979	921,641	0.1
Forestar Group, Inc.	8.00%	04/15/2024		1,061	1,070,477	0.1
					3,155,612	0.3
ENERGIE						
Comstock Resources Inc.	7.50%	05/15/2025		343	302,624	0.0
Parkland Corp./Canada	6.00%	04/01/2026		3,029	3,059,523	0.3
					3,362,147	0.3
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
Algeco Global Finance PLC	6.50%	02/15/2023	EUR	497	521,272	0.1
DIENSTLEISTUNGEN						
Carlson Travel, Inc.	6.75%	12/15/2023	USD	3,677	2,403,130	0.2
Nielsen Co. Luxembourg SARL (The)	5.50%	10/01/2021		400	400,528	0.1
					2,803,658	0.3
					21,607,769	2.2
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS						
CLO – VARIABEL VERZINSLICH						
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A1(c)	2.02%	04/26/2031		2,700	2,609,221	0.3
Sound Point CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A(c)	2.22%	04/15/2031		2,700	2,591,992	0.3
TIAA CLO II Ltd., Series 2017-1A, Class A(c)	2.42%	04/20/2029		2,140	2,098,064	0.2
					7,299,277	0.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
ABN AMRO Bank NV	7.75%	05/15/2023		400	454,230	0.0
INDUSTRIE						
TECHNOLOGIE						
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028		3,683	3,856,622	0.4
					4,310,852	0.4

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ABS-ANLEIHEN						
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS						
DB Master Finance LLC, Series 2017-1A, Class A2I	3.63%	11/20/2047	USD	2,699	$ 2,716,852	0.3%
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	05/15/2022		1,845	1,749,291	0.2
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN						
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS						
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-CBX, Class E.	5.13%	06/15/2045		228	133,639	0.0
					37,817,680	3.8
Gesamtanlagen						
(Kosten $978,554,942)					$ 953,143,689	95.1%
Termineinlagen						
Barclays, London(d)	0.01 %	–			19,353,728	1.9
BBH, Grand Cayman(d)	0.01 %	–			78	0.0
BBH, Grand Cayman(d)	0.04 %	–			1,917	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(d)	(0.67)%	–			680,123	0.1
Sumitomo, Tokyo(d)	0.01 %	–			57,287	0.0
Termineinlagen insgesamt					20,093,133	2.0
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					28,873,208	2.9
Nettovermögen					$ 1,002,110,030	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	915	$ 114,803,906	$ 114,946,875	$ 142,969
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2020	62	8,605,102	8,621,875	16,773
Short					
Euro-BOBL Futures	06/08/2020	170	25,707,736	25,503,953	203,783
					$ 363,525

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	EUR	1,707	USD	1,859	06/10/2020	$ (36,461)
Bank of America, NA.	USD	3,560	EUR	3,282	06/10/2020	83,633
BNP Paribas SA	USD	1,311	BRL	7,048	06/02/2020	10,144
BNP Paribas SA	BRL	7,048	USD	1,309	07/02/2020	(10,087)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	2,706	USD	2,939	06/10/2020	(64,936)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	2,340	EUR	2,146	06/10/2020	43,129
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	919	AUD	1,418	06/12/2020	26,405
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,690	CAD	2,364	06/12/2020	26,898
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,162	CHF	3,070	06/12/2020	30,131
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	90,067	EUR	82,749	06/12/2020	1,805,508
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,683	GBP	2,989	06/12/2020	8,291
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,366	GBP	1,106	06/12/2020	(525)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	931	SGD	1,318	06/12/2020	2,549
Citibank, NA NY	EUR	1,279	USD	1,407	06/10/2020	(12,713)
Citibank, NA NY	GBP	6,092	USD	7,451	07/17/2020	(73,891)
Citibank, NA NY	INR	145,277	USD	1,859	07/23/2020	(54,278)
Deutsche Bank AG	EUR	2,608	USD	2,826	06/10/2020	(69,333)
JPMorgan Chase Bank	EUR	1,721	USD	1,882	06/10/2020	(28,552)
JPMorgan Chase Bank	USD	2,216	EUR	2,033	06/10/2020	41,049
JPMorgan Chase Bank	ZAR	10,357	USD	560	07/17/2020	(27,566)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	960	USD	1,056	06/10/2020	(10,286)
Morgan Stanley Capital Services LLC	RUB	128,374	USD	1,719	07/14/2020	(91,461)
Royal Bank Of Scotland PLC	EUR	1,205	USD	1,316	06/10/2020	(21,423)
Royal Bank Of Scotland PLC	USD	777	EUR	709	06/10/2020	10,187
Standard Chartered Bank	USD	1,674	EUR	1,525	06/10/2020	19,122
UBS	BRL	7,048	USD	1,249	06/02/2020	(71,655)
UBS	EUR	53,957	USD	58,330	06/10/2020	(1,574,244)
						$ (40,365)
					Wertsteigerung	$ 2,107,046
					Wertminderung	$ (2,147,411)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 31, 5 Year Index	12/20/2023	USD 11,817	$ 291,801	$ 1,062,993
Verkaufskontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 31, 5 Year Index	12/20/2023	11,817	(291,801)	(621,976)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 33, 5 Year Index	12/20/2024	46,270	(1,099,535)	(4,577,207)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 33, 5 Year Index	06/20/2025	EUR 3,511	119,725	166,411
Insgesamt				$ (979,810)	$ (3,969,779)
				Wertsteigerung	$ 1,229,404
				Wertminderung	$ (5,199,183)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal-betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 24,520	12/16/2026	2.342%	3 Month LIBOR	$ (3,013,751)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Markt-wert	Vorab-gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte						
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,290	$ 1,160,572	$ 280,536	$ 880,036
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	5,090	2,579,612	631,176	1,948,436
Verkaufskontrakte						
Credit Suisse International	International Game Technology PLC	06/20/2022	EUR 1,530	36,503	65,010	(28,507)
Credit Suisse International	International Game Technology PLC	06/20/2022	1,840	43,899	85,838	(41,939)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,159	(387,686)	(76,132)	(311,554)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,863	(1,292,174)	(260,502)	(1,031,672)
Goldman Sachs International	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	660	(120,666)	47,265	(167,931)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	168	(56,196)	(11,025)	(45,171)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,550	(1,187,475)	(246,251)	(941,224)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,566	(1,807,248)	(445,751)	(1,361,497)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,566	(1,807,248)	(434,110)	(1,373,138)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,371	(2,215,378)	(506,559)	(1,708,819)
Insgesamt				$ (5,053,485)	$ (870,505)	$ (4,182,980)
					Wertsteigerung	$ 2,828,472
					Wertminderung	$ (7,011,452)

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation erhalten					
Barclays Bank PLC					
iBoxx $ Liquid High Yield Index	55,710,000	LIBOR Plus 0.00%	USD 55,710	12/20/2020	$ (2,774,351)
JPMorgan Chase Bank, NA					
iBoxx $ Liquid High Yield Index	11,435,000	LIBOR Plus 0.00%	11,435	06/20/2020	1,573,041
iBoxx $ Liquid High Yield Index	35,035,000	LIBOR Plus 0.00%	35,035	06/20/2020	6,152,022
iBoxx $ Liquid High Yield Index	10,800,000	LIBOR Plus 0.00%	10,800	12/20/2020	1,877,917
Insgesamt					$ 6,828,629
				Wertsteigerung	$ 9,602,980
				Wertminderung	$ (2,774,351)
Swaps insgesamt					$ (4,337,881)

(a) Zahlungen in Sachwerten (PIK).

(b) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.

(c) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2020.

(d) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
BRL – Brazilian Real
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
INR – Indian Rupee
NOK – Norwegian Krone
RUB – Russian Ruble
SGD – Singapore Dollar
TRY – Turkish Lira
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ABS – Asset-Backed Securities
BOBL – Bundesobligationen
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
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
LIBOR – London Interbank Offered Rate

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONSAUSRÜSTUNG			
Cisco Systems, Inc.	926,048	$ 44,283,615	1.3%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
PayPal Holdings, Inc.	163,383	25,325,999	0.7
Visa, Inc. - Class A	391,550	76,446,222	2.2
		101,772,221	2.9
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Intel Corp.	1,134,325	71,383,072	2.1
NVIDIA Corp.	96,028	34,091,861	1.0
QUALCOMM, Inc.	349,831	28,294,331	0.8
Texas Instruments, Inc.	220,166	26,142,511	0.7
		159,911,775	4.6
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	66,151	25,573,977	0.7
Microsoft Corp.	1,206,492	221,089,659	6.4
salesforce.com, Inc.	122,257	21,369,301	0.6
		268,032,937	7.7
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	542,233	172,397,560	5.0
		746,398,108	21.5
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	154,780	44,570,449	1.3
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	300,026	28,478,468	0.8
Baxter International, Inc.	283,424	25,510,994	0.8
Boston Scientific Corp.	1,116,500	42,415,835	1.2
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	217,357	27,460,883	0.8
		123,866,180	3.6
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Cigna Corp.	245,707	48,482,905	1.4
Humana, Inc.	70,493	28,947,950	0.8
UnitedHealth Group, Inc.	332,837	101,465,360	2.9
		178,896,215	5.1
PHARMAZEUTIKA			
Eli Lilly & Co.	261,714	40,029,156	1.1
Johnson & Johnson	619,038	92,081,903	2.7
Merck & Co., Inc.	1,275,879	102,988,953	3.0
		235,100,012	6.8
		582,432,856	16.8
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of America Corp.	1,536,691	37,064,987	1.1
Citigroup, Inc.	576,548	27,622,415	0.8
JPMorgan Chase & Co.	719,663	70,030,406	2.0
PNC Financial Services Group, Inc. (The)	626,360	71,430,094	2.0
		206,147,902	5.9
KAPITALMÄRKTE			
BlackRock, Inc. - Class A	25,710	13,591,334	0.4
Charles Schwab Corp. (The)	981,046	35,229,362	1.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	373,249	73,339,696	2.1
		122,160,392	3.5
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Berkshire Hathaway, Inc. - Class B	498,751	92,558,211	2.7
		420,866,505	12.1
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Comcast Corp. - Class A	696,770	27,592,092	0.8
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	1,067,238	76,819,791	2.2
Netflix, Inc.	54,657	22,941,183	0.7
Vivendi SA	1,282,008	29,313,552	0.8
Walt Disney Co. (The)	215,058	25,226,303	0.7
		154,300,829	4.4

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	89,503	$127,892,627	3.7%
Facebook, Inc. - Class A	333,674	75,106,681	2.2
		202,999,308	5.9
		384,892,229	11.1
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
L3Harris Technologies, Inc.	134,439	26,813,859	0.8
Raytheon Technologies Corp.	385,172	24,851,297	0.7
		51,665,156	1.5
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Jacobs Engineering Group, Inc.	895,568	75,245,623	2.2
INDUSTRIEKONZERNE			
Honeywell International, Inc.	971,170	141,645,145	4.1
STRASSE UND SCHIENE			
Norfolk Southern Corp.	218,549	38,965,101	1.1
Union Pacific Corp.	288,532	49,010,046	1.4
		87,975,147	2.5
		356,531,071	10.3
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Starbucks Corp.	193,093	15,059,323	0.4
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	66,296	13,749,127	0.4
Amazon.com, Inc.	57,299	139,945,359	4.1
Booking Holdings, Inc.	12,769	20,933,754	0.6
		174,628,240	5.1
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Target Corp.	82,924	10,144,093	0.3
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Home Depot, Inc. (The)	205,271	51,005,738	1.5
Lowe's Cos., Inc.	291,654	38,017,099	1.1
Ulta Beauty, Inc.	48,527	11,841,073	0.3
		100,863,910	2.9
		300,695,566	8.7
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	418,963	19,557,193	0.6
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Costco Wholesale Corp.	61,214	18,882,683	0.5
Walmart, Inc.	237,672	29,485,588	0.9
		48,368,271	1.4
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The)	1,613,452	187,031,356	5.4
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Estee Lauder Cos., Inc. (The) - Class A	78,861	15,572,681	0.4
		270,529,501	7.8
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
NextEra Energy, Inc.	400,574	102,370,692	3.0
NRG Energy, Inc.	1,336,923	48,196,074	1.4
		150,566,766	4.4
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Chevron Corp.	560,568	51,404,085	1.5
EOG Resources, Inc.	835,773	42,599,350	1.2
		94,003,435	2.7
GRUNDSTOFFE			
CONTAINER UND VERPACKUNGEN			
Berry Global Group, Inc.	789,613	35,461,520	1.0
		3,342,377,557	96.4

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
VORZUGSAKTIEN					
VERBRAUCHSGÜTER					
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Dream Holdings, Inc., Series 2(a)	0.00%		257,130	$ 1,394,930	0.0%
Dream Holdings, Inc., Series D(a)	0.00%		1,394,469	5,807,963	0.2
				7,202,893	0.2
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER					
Honest Co., Inc. (The), Series D(a)	0.00%		52,760	1,514,416	0.1
				8,717,309	0.3
Gesamtanlagen					
(Kosten $3,090,569,048)				$ 3,351,094,866	96.7%
Termineinlagen					
Barclays, London(b)	0.01 %	–		79,174,300	2.3
BBH, Grand Cayman(b)	0.04 %	–		8	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.67)%	–		401,326	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.26)%	–		219,603	0.0
Termineinlagen insgesamt				79,795,237	2.3
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				34,708,162	1.0
Nettovermögen				$ 3,465,598,265	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	28,353	CHF	27,523	06/12/2020	$ 270,720
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	12,607	GBP	10,232	06/12/2020	29,819
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	92,736	JPY	9,956,882	06/12/2020	(399,298)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,337	SGD	3,311	06/12/2020	6,682
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	244,217	EUR	222,317	06/22/2020	2,663,474
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	11	SGD	16	06/22/2020	16
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	44	AUD	67	06/30/2020	310
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	96	CZK	2,368	06/30/2020	1,558
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10	PLN	39	06/30/2020	59
						$ 2,573,340
					Wertsteigerung	$ 2,972,638
					Wertminderung	$ (399,298)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CHF – Swiss Franc
CZK – Czech Koruna
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
JPY – Japanese Yen
PLN – Polish Zloty
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE							
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE							
AUSTRALIEN							
	Australia Government Bond, Series 150	3.00%	03/21/2047	AUD	9,440	$ 8,002,949	0.7%
ÖSTERREICH							
	Republic of Austria Government Bond	0.00%	02/20/2030	EUR	4,300	4,838,109	0.5
	Republic of Austria Government Bond	0.50%	04/20/2027		2,650	3,110,571	0.3
	Republic of Austria Government Bond	0.50%	02/20/2029		13,530	15,923,795	1.5
	Republic of Austria Government Bond	0.75%	02/20/2028		4,505	5,390,617	0.5
	Republic of Austria Government Bond	1.20%	10/20/2025		5,715	6,904,508	0.6
						36,167,600	3.4
BELGIEN							
	Kingdom of Belgium Government Bond, Series 81	0.80%	06/22/2027		796	947,034	0.1
	Kingdom of Belgium Government Bond, Series 85	0.80%	06/22/2028		7,785	9,315,395	0.9
						10,262,429	1.0
KANADA							
	Canadian Government Bond	1.25%	03/01/2025	CAD	5,525	4,176,860	0.4
CHINA							
	China Government Bond, Series 1916	3.12%	12/05/2026	CNY	29,810	4,269,574	0.4
	China Government Bond, Series INBK	3.39%	03/16/2050		27,770	3,814,528	0.4
						8,084,102	0.8
FINNLAND							
	Finland Government Bond	0.50%	09/15/2027	EUR	6,432	7,562,811	0.7
	Finland Government Bond	0.50%	09/15/2029		6,435	7,599,955	0.7
	Finland Government Bond	0.88%	09/15/2025		18,364	21,817,637	2.1
						36,980,403	3.5
DEUTSCHLAND							
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	05/15/2035		4,190	4,818,699	0.5
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	1.25%	08/15/2048		7,070	10,683,358	1.0
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007	4.25%	07/04/2039		1,245	2,571,299	0.2
						18,073,356	1.7
IRLAND							
	Ireland Government Bond	1.00%	05/15/2026		2,210	2,622,934	0.2
ITALIEN							
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.95%	03/01/2023		9,505	10,672,599	1.0
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.85%	07/01/2025		21,820	25,196,285	2.4
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	3.25%	09/01/2046		652	849,933	0.1
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	3.35%	03/01/2035		2,232	2,937,981	0.3
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	3.85%	09/01/2049		124	178,710	0.0
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.50%	05/01/2023		8,560	10,582,368	1.0
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro, Series CAC	2.45%	09/01/2050		3,877	4,360,077	0.4
						54,777,953	5.2
JAPAN							
	Japan Government Ten Year Bond, Series 357	0.10%	12/20/2029	JPY	2,832,400	26,539,827	2.5
	Japan Government Thirty Year Bond, Series 26	2.40%	03/20/2037		179,200	2,235,943	0.2
	Japan Government Thirty Year Bond, Series 62	0.50%	03/20/2049		1,232,500	11,473,966	1.1
	Japan Government Thirty Year Bond, Series 65	0.40%	12/20/2049		267,600	2,417,440	0.2
	Japan Government Twenty Year Bond, Series 150	1.40%	09/20/2034		1,172,800	12,707,270	1.2
	Japan Government Twenty Year Bond, Series 157	0.20%	06/20/2036		166,850	1,530,661	0.1
	Japan Government Twenty Year Bond, Series 159	0.60%	12/20/2036		286,200	2,790,346	0.3
	Japan Government Twenty Year Bond, Series 171	0.30%	12/20/2039		418,800	3,852,131	0.4
						63,547,584	6.0
MALAYSIA							
	Malaysia Government Bond, Series 0310	4.50%	04/15/2030	MYR	14,032	3,650,757	0.3
MEXIKO							
	Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047	MXN	78,090	3,901,287	0.4
SÜDKOREA							
	Korea Treasury Bond, Series 2503	1.50%	03/10/2025	KRW	24,743,490	20,335,294	1.9
SPANIEN							
	Spain Government Bond	1.40%	04/30/2028	EUR	5,895	7,104,522	0.7
	Spain Government Bond	1.95%	04/30/2026		21,325	26,320,270	2.5
	Spain Government Bond	4.20%	01/31/2037		1,530	2,561,951	0.2
	Spain Government Bond	4.40%	10/31/2023		3,735	4,807,003	0.5
						40,793,746	3.9
VEREINIGTES KÖNIGREICH							
	United Kingdom Gilt	1.50%	07/22/2047	GBP	1,895	2,879,633	0.3
	United Kingdom Gilt	1.75%	09/07/2037		7,909	11,798,186	1.1
	United Kingdom Gilt	1.75%	01/22/2049		6,776	10,946,561	1.0
	United Kingdom Gilt	3.50%	01/22/2045		1,825	3,754,491	0.4
						29,378,871	2.8

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
VEREINIGTE STAATEN						
U.S. Treasury Bonds(a)	3.00%	02/15/2048	USD	6,465	$ 8,860,081	0.8%
U.S. Treasury Bonds	3.00%	08/15/2048		3,470	4,775,588	0.5
U.S. Treasury Bonds	4.25%	05/15/2039		2,245	3,473,436	0.3
U.S. Treasury Bonds(a)	4.50%	02/15/2036		3,705	5,679,649	0.5
U.S. Treasury Bonds(a)	4.50%	08/15/2039		10,280	16,370,900	1.6
					39,159,654	3.7
					379,915,779	35.9
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Anglo American Capital PLC	1.63%	09/18/2025	EUR	779	865,593	0.1
Anglo American Capital PLC	5.38%	04/01/2025	USD	2,547	2,793,086	0.3
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030		1,280	1,108,800	0.1
Glencore Finance Europe Ltd	3.13%	03/26/2026	GBP	670	808,501	0.1
Glencore Funding LLC	4.63%	04/29/2024	USD	2,015	2,160,178	0.2
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024		1,023	1,102,922	0.1
Inversiones CMPC SA	3.85%	01/13/2030		1,834	1,845,686	0.2
Minera y Metalurgica del Boleo SAPI de CV	3.25%	04/17/2024		2,545	2,653,958	0.2
SABIC Capital II BV	4.00%	10/10/2023		1,599	1,672,954	0.1
					15,011,678	1.4
INVESTITIONSGÜTER						
CNH Industrial Finance Europe SA	1.75%	09/12/2025	EUR	180	197,312	0.0
CRH Finland Services Oyj	0.88%	11/05/2023		284	316,344	0.0
Eaton Capital Unlimited Co	0.70%	05/14/2025		550	608,127	0.1
General Electric Co.	0.88%	05/17/2025		1,497	1,548,817	0.1
General Electric Co.	3.45%	05/01/2027	USD	2,012	1,999,989	0.2
Johnson Controls International PLC	1.00%	09/15/2023	EUR	2,045	2,269,509	0.2
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	4.40%	03/15/2024	USD	654	666,478	0.1
					7,606,576	0.7
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	4.20%	03/15/2028		130	144,104	0.0
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	5.38%	05/01/2047		490	578,711	0.1
Comcast Corp.	0.75%	02/20/2032	EUR	1,615	1,736,562	0.2
Fox Corp.	4.71%	01/25/2029	USD	3,130	3,665,527	0.3
Prosus NV	3.68%	01/21/2030		2,089	2,162,442	0.2
ViacomCBS, Inc.	3.38%	02/15/2028		1,232	1,237,128	0.1
ViacomCBS, Inc.	3.50%	01/15/2025		184	192,183	0.0
ViacomCBS, Inc.	3.70%	06/01/2028		1,791	1,829,910	0.2
ViacomCBS, Inc.	4.75%	05/15/2025		635	695,517	0.1
					12,242,084	1.2
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
AT&T, Inc.	1.60%	05/19/2028	EUR	1,530	1,730,092	0.1
AT&T, Inc.	3.40%	05/15/2025	USD	1,780	1,920,395	0.2
AT&T, Inc.	3.80%	02/15/2027		371	406,078	0.0
AT&T, Inc.	4.13%	02/17/2026		610	679,813	0.1
AT&T, Inc., Series B(b)	2.88%	03/02/2025	EUR	700	731,599	0.1
Bell Canada, Inc.	4.70%	09/11/2023	CAD	1,000	791,364	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	USD	1,629	2,567,754	0.2
CK Hutchison Group Telecom Finance SA	0.75%	04/17/2026	EUR	1,932	2,088,682	0.2
Rogers Communications, Inc.	4.00%	06/06/2022	CAD	1,305	997,057	0.1
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025	USD	2,685	2,848,398	0.3
					14,761,232	1.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Aptiv Corp.	4.15%	03/15/2024		539	568,395	0.1
BMW US Capital LLC	3.90%	04/09/2025		1,599	1,726,909	0.2
Dongfeng Motor Hong Kong International Co., Ltd.	1.15%	10/23/2021	EUR	1,203	1,333,721	0.1
General Motors Co.	6.13%	10/01/2025	USD	57	62,131	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027		433	494,272	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	3.95%	04/13/2024		815	816,144	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.10%	01/17/2024		826	858,464	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.20%	03/20/2023		299	311,710	0.0
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	0.90%	11/19/2024	EUR	749	754,897	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	4.05%	02/04/2022	USD	2,351	2,389,360	0.2
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030		501	445,659	0.0
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027		1,257	1,199,335	0.1
Nissan Motor Acceptance Corp.	3.15%	03/15/2021		3,470	3,378,717	0.3
Volkswagen Financial Services AG	1.38%	10/16/2023	EUR	1,076	1,194,790	0.1
Volkswagen Group of America Finance LLC	3.35%	05/13/2025	USD	1,163	1,211,311	0.1
					16,745,815	1.6

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG						
Carnival Corp.	1.88%	11/07/2022	EUR	1,110	$ 950,360	0.1%
Carnival PLC	1.00%	10/28/2029		1,640	1,104,384	0.1
					2,054,744	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Marriott International, Inc./MD(c)	1.65%	03/08/2021	USD	332	327,007	0.1
Marriott International, Inc./MD	5.75%	05/01/2025		1,132	1,226,063	0.1
					1,553,070	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS						
Starbucks Corp.	4.50%	11/15/2048		880	1,018,399	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
AutoNation, Inc.	4.75%	06/01/2030		596	621,960	0.0
Lowe's Cos., Inc.	4.55%	04/05/2049		745	928,396	0.1
					1,550,356	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Abbott Ireland Financing DAC	0.88%	09/27/2023	EUR	1,795	2,027,779	0.2
AbbVie, Inc.	2.63%	11/15/2028		1,782	2,196,319	0.2
Altria Group, Inc.	1.70%	06/15/2025		1,055	1,196,527	0.1
Altria Group, Inc.	2.20%	06/15/2027		1,545	1,784,453	0.2
Altria Group, Inc.	3.40%	05/06/2030	USD	468	493,664	0.0
Amgen, Inc.	4.66%	06/15/2051		1,345	1,757,107	0.2
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	5.55%	01/23/2049		1,650	2,075,809	0.2
BAT Capital Corp.	3.22%	09/06/2026		2,000	2,087,105	0.2
Baxter International, Inc.	0.40%	05/15/2024	EUR	425	470,715	0.0
DH Europe Finance II SARL	0.45%	03/18/2028		1,128	1,211,351	0.1
Kraft Heinz Foods Co.	2.25%	05/25/2028		1,107	1,208,466	0.1
Medtronic Global Holdings SCA	0.25%	07/02/2025		836	919,914	0.1
Mylan NV	3.95%	06/15/2026	USD	2,370	2,589,075	0.2
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	1.13%	11/21/2022	EUR	2,730	3,069,696	0.3
Tyson Foods, Inc.	4.00%	03/01/2026	USD	768	867,423	0.1
Unilever PLC	1.50%	07/22/2026	GBP	1,258	1,618,641	0.2
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	3.05%	01/15/2026	USD	1,826	1,931,913	0.2
					27,505,957	2.6
ENERGIE						
BG Energy Capital PLC	5.13%	12/01/2025	GBP	1,142	1,693,323	0.2
Boardwalk Pipelines LP	4.80%	05/03/2029	USD	1,270	1,233,913	0.1
Boardwalk Pipelines LP	5.95%	06/01/2026		355	362,002	0.0
BP Capital Markets PLC	1.57%	02/16/2027	EUR	500	567,032	0.1
Ecopetrol SA	5.88%	09/18/2023	USD	1	1,078	0.0
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027		649	656,507	0.1
Energy Transfer Operating LP	3.75%	05/15/2030		904	890,605	0.1
Energy Transfer Operating LP	4.20%	04/15/2027		99	100,132	0.0
Energy Transfer Operating LP	5.25%	04/15/2029		1,335	1,430,423	0.1
Energy Transfer Operating LP	5.50%	06/01/2027		1,019	1,096,777	0.1
Eni SpA	4.25%	05/09/2029		2,046	2,153,858	0.2
Husky Energy, Inc.	4.40%	04/15/2029		2,410	2,275,147	0.2
Marathon Petroleum Corp.	4.70%	05/01/2025		1,006	1,112,244	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	05/07/2021		469	471,345	0.0
ONEOK, Inc.	3.10%	03/15/2030		1,550	1,405,517	0.1
ONEOK, Inc.	4.55%	07/15/2028		2,099	2,098,246	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.55%	12/15/2029		466	437,282	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.60%	11/01/2024		1,280	1,281,100	0.1
Saudi Arabian Oil Co.	2.88%	04/16/2024		1,950	2,012,400	0.2
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026		1,952	1,962,370	0.2
TransCanada PipeLines Ltd.	9.88%	01/01/2021		635	666,751	0.1
Valero Energy Corp.	6.63%	06/15/2037		1,350	1,747,110	0.2
					25,655,162	2.4
DIENSTLEISTUNGEN						
eBay, Inc.	3.80%	03/09/2022		1,723	1,805,506	0.2
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025		303	323,682	0.0
Expedia Group, Inc.	7.00%	05/01/2025		374	399,948	0.0
IHS Markit Ltd.	3.63%	05/01/2024		725	758,552	0.1
					3,287,688	0.3
TECHNOLOGIE						
Baidu, Inc.	3.88%	09/29/2023		2,440	2,593,262	0.3
Broadcom, Inc.	4.25%	04/15/2026		385	412,323	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	0.63%	12/03/2025	EUR	317	348,519	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	1.50%	05/21/2027		2,300	2,652,506	0.3
International Business Machines Corp.	0.38%	01/31/2023		1,721	1,910,628	0.2
Leidos, Inc.	3.63%	05/15/2025	USD	241	258,685	0.0
NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA, Inc.	2.70%	05/01/2025		294	302,185	0.0
					8,478,108	0.8

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN						
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	USD	1,053	$ 1,089,823	0.1%
Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025		2,660	2,702,766	0.3
					3,792,589	0.4
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN						
Pacific National Finance Pty Ltd.	4.63%	09/23/2020		167	168,284	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027		1,785	1,677,900	0.2
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022		60	50,377	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027		56	38,656	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023		192	152,964	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025		71	51,242	0.0
DP World Crescent Ltd.	3.75%	01/30/2030		481	454,160	0.1
DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029		412	394,361	0.0
DP World Crescent Ltd.	4.85%	09/26/2028		1,985	2,037,106	0.2
Heathrow Funding Ltd.	6.75%	12/03/2026	GBP	140	210,113	0.0
					5,066,879	0.5
					146,498,621	13.9
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
ABN AMRO Bank NV	1.25%	05/28/2025	EUR	100	112,116	0.0
ABN AMRO Bank NV	4.40%	03/27/2028	USD	2,200	2,267,953	0.2
ABN AMRO Bank NV	4.75%	07/28/2025		1,605	1,739,598	0.1
AIB Group PLC	4.75%	10/12/2023		1,872	1,970,882	0.2
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	4.40%	05/19/2026		1,739	1,896,854	0.2
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025		1,400	1,545,520	0.1
Bank of America Corp.	1.38%	02/07/2025	EUR	2,315	2,631,653	0.3
Bank of Ireland Group PLC	4.50%	11/25/2023	USD	2,700	2,809,142	0.3
Bank of New York Mellon Corp. (The), Series G(b)	4.70%	09/20/2025		832	855,008	0.1
Barclays PLC	3.38%	04/02/2025	EUR	2,220	2,634,347	0.3
BNP Paribas SA	4.38%	09/28/2025	USD	2,715	2,922,259	0.3
BNP Paribas SA	4.38%	05/12/2026		200	216,296	0.0
BNP Paribas SA	4.63%	03/13/2027		1,095	1,197,409	0.1
BPCE SA	4.63%	07/11/2024		280	298,763	0.0
BPCE SA	5.70%	10/22/2023		1,973	2,160,888	0.2
Capital One Financial Corp.	0.80%	06/12/2024	EUR	1,322	1,388,583	0.1
Capital One Financial Corp.	1.65%	06/12/2029		2,330	2,376,526	0.2
Citigroup, Inc.	0.75%	10/26/2023		2,440	2,722,140	0.3
Citigroup, Inc.	1.25%	07/06/2026		1,045	1,172,421	0.1
Citigroup, Inc.	1.50%	07/24/2026		137	155,899	0.0
Citigroup, Inc., Series V(b)	4.70%	01/30/2025	USD	56	48,885	0.0
Commonwealth Bank of Australia	4.50%	12/09/2025		1,585	1,752,125	0.2
Cooperatieve Rabobank UA(b)	3.25%	12/29/2026	EUR	1,600	1,651,584	0.2
Cooperatieve Rabobank UA	4.38%	08/04/2025	USD	1,065	1,174,772	0.1
Credit Agricole SA/London	3.75%	04/24/2023		760	804,901	0.1
Credit Suisse Group AG	4.19%	04/01/2031		3,550	3,938,419	0.4
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	3.80%	06/09/2023		250	265,897	0.0
Danske Bank A/S	3.24%	12/20/2025		2,065	2,110,293	0.2
Danske Bank A/S	5.38%	01/12/2024		205	224,358	0.0
DNB Bank ASA(b)	6.50%	03/26/2022		1,845	1,902,247	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	0.13%	08/19/2024	EUR	876	940,877	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	1.25%	05/01/2025		242	270,528	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.00%	07/27/2023		2,379	2,732,031	0.3
HSBC Holdings PLC, Series E(b)	4.75%	07/04/2029		262	279,197	0.0
ING Groep NV	2.13%	05/26/2031		700	785,741	0.1
ING Groep NV	3.00%	02/18/2026	GBP	1,900	2,501,074	0.2
Intesa Sanpaolo SpA	3.13%	07/14/2022	USD	3,725	3,756,903	0.4
JPMorgan Chase & Co.	2.08%	04/22/2026		2,380	2,438,770	0.2
JPMorgan Chase & Co.	3.78%	02/01/2028		1,639	1,814,542	0.2
Macquarie Group Ltd.	0.63%	02/03/2027	EUR	1,315	1,389,994	0.1
Morgan Stanley	2.19%	04/28/2026	USD	1,402	1,440,334	0.1
Morgan Stanley, Series G.	1.38%	10/27/2026	EUR	940	1,084,786	0.1
Morgan Stanley, Series G.	1.75%	03/11/2024		915	1,058,518	0.1
Nationwide Building Society	3.62%	04/26/2023	USD	291	298,145	0.0
Nationwide Building Society	4.00%	09/14/2026		538	563,538	0.1
NatWest Markets PLC	2.75%	04/02/2025	EUR	2,040	2,378,116	0.2
Nordea Bank Abp(c)	1.30%	08/30/2023	USD	230	226,626	0.0
Royal Bank of Canada	1.38%	12/09/2024	GBP	1,423	1,767,968	0.2
Santander UK Group Holdings PLC	4.75%	09/15/2025	USD	2,785	2,945,917	0.3
Societe Generale SA	5.00%	01/17/2024		2,560	2,716,842	0.3
Standard Chartered PLC(b) (c)	2.27%	01/30/2027		1,700	1,343,673	0.1
Standard Chartered PLC	3.79%	05/21/2025		1,140	1,194,118	0.1
Standard Chartered PLC	5.20%	01/26/2024		745	796,967	0.1
Swedbank AB(b)	6.00%	03/17/2022		1,400	1,401,336	0.1

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
	Swedbank AB, Series NC5(b)	5.63%	09/17/2024	USD	200	$ 198,582	0.0%
	UBS Group AG(b)	5.75%	02/19/2022	EUR	1,770	2,041,196	0.2
	UniCredit SpA	3.75%	04/12/2022	USD	1,835	1,859,070	0.2
	UniCredit SpA	6.57%	01/14/2022		1,425	1,485,326	0.1
	Wells Fargo & Co.	2.39%	06/02/2028		2,490	2,510,492	0.2
	Wells Fargo & Co.	2.41%	10/30/2025		431	441,800	0.0
	Wells Fargo Bank NA	5.25%	08/01/2023	GBP	1,450	1,977,567	0.2
						93,588,312	8.8
MAKLER							
	Charles Schwab Corp. (The), Series G(b)	5.38%	06/01/2025	USD	1,371	1,439,040	0.1
FINANZEN							
	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	2.88%	08/14/2024		158	132,107	0.0
	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023		158	139,993	0.0
	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.65%	07/21/2027		158	130,587	0.0
	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.13%	07/03/2023		158	140,211	0.0
	Air Lease Corp.	3.00%	02/01/2030		51	42,179	0.0
	Air Lease Corp.	3.88%	07/03/2023		91	85,350	0.0
	Air Lease Corp.	4.25%	02/01/2024		386	364,672	0.1
	Air Lease Corp., Series G	3.75%	06/01/2026		78	70,944	0.0
	GE Capital Funding LLC	3.45%	05/15/2025		1,010	1,024,743	0.1
	Synchrony Financial	3.95%	12/01/2027		560	534,683	0.1
	Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025		1,195	1,204,149	0.1
						3,869,618	0.4
VERSICHERUNGEN							
	Alleghany Corp.	3.63%	05/15/2030		1,967	2,048,207	0.2
	Assicurazioni Generali SpA	5.00%	06/08/2048	EUR	1,237	1,505,159	0.2
	Assicurazioni Generali SpA, Series E	5.50%	10/27/2047		885	1,100,654	0.1
	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama	6.00%	01/23/2027		700	936,151	0.1
	Centene Corp.	4.25%	12/15/2027	USD	282	294,794	0.0
	Centene Corp.	4.63%	12/15/2029		370	398,372	0.0
	Chubb INA Holdings, Inc.	0.30%	12/15/2024	EUR	987	1,072,117	0.1
	Chubb INA Holdings, Inc.	0.88%	06/15/2027		1,685	1,852,497	0.2
	Credit Agricole Assurances SA(b)	4.25%	01/13/2025		700	833,497	0.1
	Credit Agricole Assurances SA	4.75%	09/27/2048		1,100	1,421,886	0.1
	Friends Life Holdings PLC	8.25%	04/21/2022	GBP	690	951,121	0.1
	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	6.63%	05/26/2042		400	535,310	0.1
	Voya Financial, Inc.	5.65%	05/15/2053	USD	1,410	1,399,819	0.1
						14,349,584	1.4
SONSTIGE FINANZWERTE							
	Digital Dutch Finco BV	1.50%	03/15/2030	EUR	590	651,566	0.1
REITS							
	CyrusOne LP/CyrusOne Finance Corp.	1.45%	01/22/2027		528	541,522	0.1
	Digital Euro Finco LLC	2.50%	01/16/2026		2,181	2,576,534	0.2
	Prologis Euro Finance LLC	0.38%	02/06/2028		1,793	1,888,473	0.2
	WPC Eurobond BV	1.35%	04/15/2028		1,225	1,246,714	0.1
	WPC Eurobond BV	2.13%	04/15/2027		1,424	1,541,096	0.1
						7,794,339	0.7
						121,692,459	11.5
VERSORGUNGSBETRIEBE							
ELEKTRIZITÄT							
	Colbun SA	3.15%	03/06/2030	USD	414	403,764	0.0
	Enel Finance International NV	0.00%	06/17/2024	EUR	1,882	2,042,710	0.2
	Enel Finance International NV	2.65%	09/10/2024	USD	1,910	1,976,785	0.2
	Western Power Distribution West Midlands PLC	3.88%	10/17/2024	GBP	1,193	1,615,866	0.2
						6,039,125	0.6
ERDGAS							
	National Grid North America, Inc.	0.75%	08/08/2023	EUR	1,973	2,203,051	0.2
	Talent Yield Investments Ltd.	4.50%	04/25/2022	USD	1,415	1,469,389	0.1
						3,672,440	0.3
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE							
	Anglian Water Services Financing PLC	4.50%	02/22/2026	GBP	160	215,195	0.0
	Severn Trent Utilities Finance PLC	3.63%	01/16/2026		1,045	1,446,283	0.2
	Yorkshire Water Finance PLC	6.59%	02/21/2023		825	1,166,156	0.1
						2,827,634	0.3
						12,539,199	1.2
						280,730,279	26.6

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	3.50%	10/01/2049	USD 3,283	$ 3,530,690	0.3%
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	02/01/2042	392	429,589	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	11/01/2042	4,034	4,424,642	0.5
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	01/01/2043	634	695,428	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2013	3.50%	04/01/2043	2,426	2,661,443	0.2
Federal National Mortgage Association, Series 2018	3.50%	03/01/2048	1,460	1,577,324	0.2
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	11/01/2049	2,000	2,149,663	0.2
Government National Mortgage Association	3.00%	06/01/2050	24,819	26,277,116	2.5
Uniform Mortgage-Backed Security	3.00%	06/01/2050	3,400	3,576,906	0.3
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2018	3.50%	06/01/2050	5,552	5,858,671	0.6
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2018	4.00%	06/01/2050	14,192	15,105,876	1.4
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2018	4.50%	06/01/2050	3,754	4,054,467	0.4
				70,341,815	6.7
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2019-2A, Class M2(c)	3.27%	04/25/2029	1,300	1,041,306	0.1
Series 2019-3A, Class M1B(c)	1.77%	07/25/2029	649	575,918	0.1
Series 2019-4A, Class M1B(c)	2.17%	10/25/2029	475	442,984	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2019-R03, Class 1M2(c)	2.32%	09/25/2031	1,833	1,791,603	0.2
Series 2019-R04, Class 2M2(c)	2.27%	06/25/2039	1,446	1,414,721	0.1
Series 2019-R06, Class 2M2(c)	2.27%	09/25/2039	942	917,907	0.1
Series 2020-R01, Class 1M2(c)	2.22%	01/25/2040	1,100	987,249	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp					
Series 2013-DN1, Class M2(c)	7.32%	07/25/2023	1,105	961,502	0.1
Series 2019-DNA4, Class M2(c)	2.12%	10/25/2049	315	297,628	0.0
Series 2019-HQA1, Class M2(c)	2.52%	02/25/2049	597	565,221	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2013-DN2, Class M2(c)	4.42%	11/25/2023	666	519,236	0.1
Series 2014-DN1, Class M2(c)	2.37%	02/25/2024	204	195,588	0.0
Series 2014-DN3, Class M3(c)	4.17%	08/25/2024	1,760	1,780,969	0.2
Series 2015-DNA1, Class M2(c)	2.02%	10/25/2027	313	312,302	0.0
Series 2016-DNA3, Class M3(c)	5.17%	12/25/2028	658	689,386	0.1
Series 2016-DNA4, Class M2(c)	1.47%	03/25/2029	22	21,976	0.0
Series 2016-HQA3, Class M3(c)	4.02%	03/25/2029	1,371	1,396,954	0.1
Series 2017-DNA2, Class M2(c)	3.62%	10/25/2029	1,012	1,028,710	0.1
Series 2017-DNA3, Class M2(c)	2.67%	03/25/2030	950	950,000	0.1
Series 2017-HQA1, Class M2(c)	3.72%	08/25/2029	2,134	2,140,268	0.2
Series 2017-HQA2, Class M2(c)	2.82%	12/25/2029	938	940,097	0.1
Series 2018-HQA1, Class M2(c)	2.47%	09/25/2030	1,521	1,418,078	0.1
Series 2019-DNA3, Class M2(c)	2.22%	07/25/2049	199	191,175	0.0
Series 2020-DNA1, Class M2(c)	1.87%	01/25/2050	270	244,299	0.0
Series 2020-HQA2, Class M2(c)	3.27%	03/25/2050	592	493,718	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C04, Class 1M2(c)	5.07%	11/25/2024	1,027	1,060,521	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(c)	5.17%	11/25/2024	1,043	1,042,863	0.1
Series 2015-C01, Class 1M2(c)	4.47%	02/25/2025	518	494,514	0.0
Series 2015-C02, Class 1M2(c)	4.17%	05/25/2025	709	670,291	0.1
Series 2015-C02, Class 2M2(c)	4.17%	05/25/2025	322	317,128	0.0
Series 2015-C03, Class 1M2(c)	5.17%	07/25/2025	1,284	1,282,408	0.1
Series 2015-C03, Class 2M2(c)	5.17%	07/25/2025	382	386,054	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(c)	5.87%	04/25/2028	30	32,021	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(c)	5.72%	04/25/2028	1,239	1,303,537	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(c)	7.12%	08/25/2028	1,116	1,205,456	0.1
Series 2016-C02, Class 1M2(c)	6.17%	09/25/2028	1,210	1,265,385	0.1
Series 2016-C04, Class 1M2(c)	4.42%	01/25/2029	834	859,825	0.1
Series 2016-C05, Class 2M2(c)	4.62%	01/25/2029	564	580,757	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(c)	4.42%	04/25/2029	583	601,670	0.1
Series 2016-C07, Class 2M2(c)	4.52%	05/25/2029	490	502,323	0.0
Series 2017-C01, Class 1M2(c)	3.72%	07/25/2029	2,596	2,630,760	0.3
Series 2017-C02, Class 2M2(c)	3.82%	09/25/2029	2,009	2,008,456	0.2
Series 2018-C01, Class 1M2(c)	2.42%	07/25/2030	1,995	1,939,621	0.2
Home Re Ltd., Series 2019-1, Class M1(c)	1.82%	05/25/2029	772	742,638	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2019-1, Class M1B(c)	2.12%	02/25/2029	989	958,157	0.1
STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class M2(c)	2.27%	09/25/2048	1,992	1,894,888	0.2
				43,098,068	4.1
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2006-J1, Class 1A11	5.50%	02/25/2036	242	214,339	0.0
Series 2007-15CB, Class A19	5.75%	07/25/2037	281	230,548	0.0
				444,887	0.0

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH						
Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust, Series 2006-AR4, Class A2(c)	0.36%	12/25/2036	USD	196	$ 91,388	0.0%
					43,634,343	4.1
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Reynolds Group Issuer, Inc./Reynolds Group Issuer LLC/ Reynolds Group Issuer Lu	5.13%	07/15/2023		2	2,223	0.0
WEPA Hygieneprodukte GmbH	2.88%	12/15/2027	EUR	1,240	1,367,083	0.1
					1,369,306	0.1
INVESTITIONSGÜTER						
Crown European Holdings SA	2.63%	09/30/2024		1,185	1,322,177	0.1
Silgan Holdings, Inc.	2.25%	06/01/2028		1,030	1,117,626	0.1
Trivium Packaging Finance BV	5.50%	08/15/2026	USD	299	313,803	0.1
					2,753,606	0.3
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Telecom Italia SpA/Milano	4.00%	04/11/2024	EUR	591	685,520	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023	USD	1,684	1,747,664	0.2
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025		377	395,943	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(d)	3.63%	05/15/2025	EUR	1,799	1,950,487	0.2
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	4.38%	05/15/2026		1,233	1,328,374	0.1
					5,422,468	0.5
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
Dufry One BV	2.00%	02/15/2027		335	304,244	0.0
Dufry One BV	2.50%	10/15/2024		135	129,626	0.0
					433,870	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	3.50%	02/15/2023	USD	646	648,297	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.63%	01/15/2027		466	473,847	0.0
Catalent Pharma Solutions, Inc.	2.38%	03/01/2028	EUR	1,467	1,543,037	0.1
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027		446	487,408	0.0
Grifols SA	1.63%	02/15/2025		2,055	2,239,710	0.2
IQVIA, Inc.	3.25%	03/15/2025		1,405	1,579,047	0.2
					6,971,346	0.6
ENERGIE						
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	4.88%	01/15/2023	USD	1,394	1,416,522	0.1
Western Midstream Operating LP	4.05%	02/01/2030		181	162,404	0.0
					1,578,926	0.1
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	EUR	550	582,852	0.1
Rexel SA	2.13%	06/15/2025		545	593,980	0.1
SPIE SA	3.13%	03/22/2024		500	549,617	0.0
					1,726,449	0.2
DIENSTLEISTUNGEN						
Arena Luxembourg Finance SARL	1.88%	02/01/2028		1,209	1,216,930	0.1
Intertrust Group BV	3.38%	11/15/2025		1,495	1,657,735	0.2
Q-Park Holding I BV	2.00%	03/01/2027		1,233	1,294,048	0.1
					4,168,713	0.4
TECHNOLOGIE						
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024	USD	573	588,503	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	7.13%	06/15/2024		150	155,819	0.0
					744,322	0.1
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Europcar Mobility Group	4.13%	11/15/2024	EUR	980	699,167	0.1
Loxam SAS	4.25%	04/15/2024		144	150,830	0.0
					849,997	0.1
					26,704,523	2.5
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(b)	8.88%	04/14/2021		2,000	2,309,080	0.2
Banco Santander SA(b)	6.75%	04/25/2022		2,200	2,489,775	0.2
Credit Suisse Group AG(b)	7.50%	07/17/2023	USD	1,422	1,465,824	0.2
					6,264,679	0.6

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
FINANZEN							
	Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR	1,633	$ 1,647,802	0.2%
	Navient Corp.	6.63%	07/26/2021	USD	1,920	1,894,681	0.2
						3,542,483	0.4
REITS							
	Iron Mountain, Inc.	3.00%	01/15/2025	EUR	1,333	1,407,328	0.1
						11,214,490	1.1
VERSORGUNGSBETRIEBE							
ELEKTRIZITÄT							
	Orano SA	3.38%	04/23/2026		300	336,248	0.0
						38,255,261	3.6
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE							
JAPAN							
	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21	0.10%	03/10/2026	JPY	346,351	3,214,781	0.3
	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 23	0.10%	03/10/2028		28,941	268,223	0.0
						3,483,004	0.3
VEREINIGTE STAATEN							
	U.S. Treasury Inflation Index(a)	0.13%	07/15/2024	USD	30,881	31,705,794	3.0
						35,188,798	3.3
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN							
KANADA							
	Canada Housing Trust No. 1	1.80%	12/15/2024	CAD	27,385	20,891,778	2.0
	Canada Housing Trust No. 1	2.25%	12/15/2025		4,870	3,825,081	0.3
	Canada Housing Trust No. 1	2.35%	06/15/2027		10,840	8,679,148	0.8
						33,396,007	3.1
FRANKREICH							
	SNCF Reseau	3.13%	10/25/2028	EUR	400	555,006	0.1
						33,951,013	3.2
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN							
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS							
	AB FCP I - Mortgage Income Portfolio - Class SA			USD	109,758	8,099,037	0.7
	AB SICAV I - China Bond - Class SA				1,579,100	22,984,774	2.2
						31,083,811	2.9
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE							
QUASI-STAATSANLEIHEN							
CHILE							
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.70%	01/30/2050		1,305	1,296,844	0.1
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031		201	215,070	0.0
	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	3.65%	05/07/2030		282	301,528	0.1
						1,813,442	0.2
CHINA							
	China Development Bank, Series 1805	4.88%	02/09/2028	CNY	117,800	18,283,638	1.7
	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd.	2.15%	05/13/2025	USD	2,061	2,092,279	0.2
	State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	1.25%	05/19/2022	EUR	372	416,552	0.1
						20,792,469	2.0
INDONESIEN							
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	USD	562	585,014	0.1
	Pertamina Persero PT	3.10%	08/25/2030		1,320	1,306,776	0.1
	Perusahaan Listrik Negara PT	4.13%	05/15/2027		918	942,671	0.1
						2,834,461	0.3
MALAYSIA							
	Petronas Capital Ltd.	3.50%	04/21/2030		522	577,809	0.1
MEXIKO							
	Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031		212	171,455	0.0
	Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047		1,040	807,300	0.1
	Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030		418	357,388	0.0
	Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050		1,430	1,190,475	0.1
						2,526,618	0.2
SÜDKOREA							
	Korea National Oil Corp.	2.00%	10/24/2021		1,695	1,714,069	0.1
						30,258,868	2.9
GEDECKTE ANLEIHEN							
	Bank of Montreal	0.75%	09/21/2022	EUR	265	300,208	0.0
	Bank of Nova Scotia (The)	0.25%	01/11/2024		1,315	1,478,655	0.1
	Canadian Imperial Bank of Commerce	0.25%	01/24/2023		3,615	4,052,821	0.4
	Cie de Financement Foncier SA	0.25%	03/16/2022		200	223,765	0.0
	Commonwealth Bank of Australia	0.38%	04/24/2023		2,170	2,440,294	0.2
	DNB Boligkreditt AS	0.25%	01/23/2023		2,240	2,517,383	0.2

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
DNB Boligkreditt AS	2.75%	03/21/2022	EUR	50	$ 58,474	0.0%
Royal Bank of Canada	0.25%	01/29/2024		2,495	2,805,889	0.2
Royal Bank of Canada	0.88%	06/17/2022		580	657,966	0.1
Santander UK PLC	0.10%	05/12/2024		723	808,141	0.1
Toronto-Dominion Bank (The)	0.25%	04/27/2022		565	631,855	0.1
Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	2.38%	05/04/2021		2,017	2,206,842	0.2
UBS AG/London	4.00%	04/08/2022		1,515	1,811,034	0.2
Westpac Securities NZ Ltd./London	0.50%	01/17/2024		470	532,773	0.1
					20,526,100	1.9
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN						
CHILE						
Chile Government International Bond	1.63%	01/30/2025	USD	1,214	1,409,085	0.1
FRANKREICH						
Dexia Credit Local SA	0.50%	01/17/2025		700	798,457	0.1
Dexia Credit Local SA	0.63%	01/21/2022		3,500	3,936,118	0.4
					4,734,575	0.5
INDONESIEN						
Indonesia Government International Bond	5.88%	01/15/2024		2,430	2,732,231	0.3
PERU						
Peruvian Government International Bond	2.39%	01/23/2026		2,383	2,462,831	0.2
KATAR						
Qatar Government International Bond	3.38%	03/14/2024		371	394,303	0.0
SAUDI-ARABIEN						
Saudi Government International Bond	2.90%	10/22/2025		365	381,217	0.0
Saudi Government International Bond	3.25%	10/26/2026		572	605,033	0.1
Saudi Government International Bond	4.50%	10/26/2046		490	547,575	0.1
Saudi Government International Bond	4.63%	10/04/2047		890	1,003,475	0.1
					2,537,300	0.3
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
Abu Dhabi Government International Bond	2.50%	04/16/2025		547	569,564	0.1
Abu Dhabi Government International Bond	3.88%	04/16/2050		437	497,634	0.0
					1,067,198	0.1
					15,337,523	1.5
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE						
SENEGAL						
Senegal Government International Bond	6.25%	07/30/2024		1,084	1,079,935	0.1
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033		1,045	976,422	0.1
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048		511	460,219	0.0
					2,516,576	0.2
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030		1,430	1,242,312	0.1
Dominican Republic International Bond	5.88%	04/18/2024		715	721,480	0.1
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027		275	267,008	0.0
					2,230,800	0.2
ÄGYPTEN						
Egypt Government International Bond	4.75%	04/16/2026	EUR	875	911,802	0.1
Egypt Government International Bond	5.75%	05/29/2024	USD	940	940,587	0.1
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032		209	197,773	0.0
					2,050,162	0.2
BAHRAIN						
Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031		1,520	1,433,550	0.2
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030		241	254,255	0.0
					1,687,805	0.2
SÜDAFRIKA						
Republic of South Africa Government International Bond	4.30%	10/12/2028		1,495	1,342,230	0.1
NIGERIA						
Nigeria Government International Bond	6.75%	01/28/2021		555	554,480	0.1
SRI LANKA						
Sri Lanka Government International Bond	6.85%	03/14/2024		778	439,813	0.0
EL SALVADOR						
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050		167	127,911	0.0
					10,949,777	1.0
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN						
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS						
Commercial Mortgage Trust, Series 2013-CR6, Class D	4.09%	03/10/2046		1,910	1,572,380	0.2
GS Mortgage Securities Trust						
Series 2010-C1, Class A2	4.59%	08/10/2043		105	105,367	0.0
Series 2011-GC5, Class D	5.39%	08/10/2044		550	398,218	0.0
Series 2013-G1, Class A2	3.56%	04/10/2031		330	309,660	0.0

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2014-C22, Class AS	4.11%	09/15/2047	USD	1,000	$ 1,043,664	0.1%
LSTAR Commercial Mortgage Trust, Series 2016-4, Class A2	2.58%	03/10/2049		262	265,280	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2013-C9, Class D	4.12%	05/15/2046		300	230,792	0.0
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2013-C11, Class B	3.71%	03/15/2045		1,758	1,740,775	0.2
					5,666,136	0.5
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS						
BX Trust, Series 2018-EXCL, Class A(c)	1.27%	09/15/2037		2,450	2,151,060	0.2
					7,817,196	0.7
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN						
KANADA						
Province of Ontario Canada	2.60%	06/02/2025	CAD	3,836	3,010,541	0.3
Province of Quebec Canada	2.75%	09/01/2025		5,013	3,976,022	0.4
					6,986,563	0.7
GEMEINDEVERWALTUNG – REGIONALANLEIHEN						
SCHWEDEN						
Kommuninvest I Sverige AB, Series 2410	1.00%	10/02/2024	SEK	53,570	5,862,622	0.6
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS						
CLO – VARIABEL VERZINSLICH						
OCP CLO Ltd. Series 2020-18A, Class A (c)				2,811,699	2,811,699	0.2
SCFF I Ltd. Series 2020-1A, Class A1 (c)				2,933,000	2,956,080	0.3
					5,767,779	0.5
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
SÜDAFRIKA						
Republic of South Africa Government Bond Series 2030			ZAR	104,559,975	5,610,545	0.5
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
INVESTITIONSGÜTER						
Odebrecht Finance Ltd.(e)	4.38%	04/25/2025	USD	585	10,054	0.0
Odebrecht Finance Ltd.(e)	5.25%	06/27/2029		277	11,080	0.0
					21,134	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026		738	700,409	0.1
BRF SA	4.88%	01/24/2030		737	679,883	0.0
					1,380,292	0.1
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Rumo Luxembourg SARL	7.38%	02/09/2024		955	998,572	0.1
					2,399,998	0.2
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.63%	02/04/2025		310	288,610	0.1
Centrais Eletricas Brasileiras SA	4.63%	02/04/2030		200	175,788	0.0
					464,398	0.1
					2,864,396	0.3
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN						
European Investment Bank	4.75%	08/07/2024	AUD	2,501	1,937,669	0.2
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN						
VEREINIGTE STAATEN						
State of California, Series 2010	7.63%	03/01/2040	USD	780	1,336,140	0.1
ABS-ANLEIHEN						
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS						
SoFi Consumer Loan Program Trust, Series 2018-1, Class B	3.65%	02/25/2027		803	799,175	0.1
					1,029,155,452	97.3
GELDMARKTANLAGEN						
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
JAPAN						
Japan Treasury Discount Bill, Series 909	0.00%	08/24/2020	JPY	2,811,050	26,073,049	2.5
					1,055,228,501	99.8
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
ABS-ANLEIHEN						
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS						
SBA Tower Trust, Series 2014-2A, Class C	3.87%	10/15/2049	USD	152	159,496	0.0

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS						
CLO – VARIABEL VERZINSLICH						
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class A1A(c)	2.47%	07/23/2032	USD	460	$ 437,565	0.0%
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN						
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH						
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes, Series 2014-HQ2, Class M3(c)	3.92%	09/25/2024		250	250,000	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-2R, Class A(c)	2.92%	05/27/2023		1,577	1,243,047	0.1
					1,493,047	0.1
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN						
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS						
DBUBS Mortgage Trust, Series 2011-LC2A, Class D	5.53%	07/10/2044		895	723,801	0.1
GS Mortgage Securities Trust, Series 2014-GC22, Class D	4.69%	06/10/2047		58	35,529	0.0
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-CBX, Class D	5.13%	06/15/2045		1,050	659,620	0.1
					1,418,950	0.2
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS						
BHMS, Series 2018-ATLS, Class A(c)	1.43%	07/15/2035		1,901	1,768,722	0.1
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(c)	1.65%	11/15/2027		752	561,158	0.1
					2,329,880	0.2
					3,748,830	0.4
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
VERSICHERUNGEN						
Nationwide Mutual Insurance Co.	9.38%	08/15/2039		345	537,286	0.1
INDUSTRIE						
TECHNOLOGIE						
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028		1,733	1,814,815	0.2
Broadcom, Inc.	4.25%	04/15/2026		1,200	1,285,162	0.1
Fiserv, Inc.	1.13%	07/01/2027	EUR	1,044	1,163,354	0.1
					4,263,331	0.4
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	3.38%	02/01/2022	USD	1,058	1,075,900	0.1
Penske Truck Leasing Co. LP/PTL Finance Corp.	3.65%	07/29/2021		1,420	1,439,830	0.1
					2,515,730	0.2
					6,779,061	0.6
					7,316,347	0.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
OCI NV	5.00%	04/15/2023	EUR	1,650	1,858,455	0.2
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	USD	922	793,842	0.1
Odebrecht Finance Ltd.(e)	7.13%	06/26/2042		355	5,991	0.0
					799,833	0.1
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
SCHATZPAPIERE						
Spain Government Bond	2.35%	07/30/2033	EUR	4,650	6,199,708	0.6
					22,013,281	2.1
Gesamtanlagen						
(Kosten $1,073,709,800)					$ 1,077,241,782	101.9%
Termineinlagen						
Bank of Nova Scotia, Toronto(f)	0.04 %	–			525,306	0.1
BBH, Grand Cayman(f)	(0.60)%	–			1	0.0
BBH, Grand Cayman(f)	0.01 %	–			4	0.0
BBH, Grand Cayman(f)	2.75 %	–			271	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(f)	(0.67)%	–			3,193,702	0.3
JPMorgan Chase, New York(f)	0.01 %	–			33,474,978	3.2
National Australia Bank, London(f)	0.01 %	–			409,632	0.0
Sumitomo, London(f)	(0.26)%	–			522,423	0.0
Sumitomo, London(f)	0.01 %	–			879,237	0.1
Termineinlagen insgesamt					39,005,554	3.7
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					(59,245,052)	(5.6)
Nettovermögen					$ 1,057,002,284	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
10 Yr Canadian Bond Futures	09/21/2020	25	$ 2,799,157	$ 2,789,701	$ (9,456)
3 Yr Australian Bond Futures	06/15/2020	62	4,826,888	4,840,339	13,451
Euro-BOBL Futures	06/08/2020	87	13,099,345	13,052,022	(47,323)
Japan 10 Yr Bond (OSE) Futures	06/15/2020	20	28,328,805	28,225,694	(103,111)
Korea 10 Yr Bond Futures	06/16/2020	84	8,950,414	9,076,572	126,158
Korea 3 Yr Bond Futures	06/16/2020	441	39,732,722	39,935,524	202,802
U.S. 10 Yr Ultra Futures	09/21/2020	42	6,574,766	6,607,781	33,015
U.S. . Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2020	126	27,597,703	27,471,938	(125,765)
Short					
10 Yr Australian Bond Futures	06/15/2020	2	199,312	198,591	721
Euro-Bund Futures	06/08/2020	175	33,939,001	33,501,863	437,138
Long Gilt Futures	09/28/2020	45	7,634,338	7,638,228	(3,890)
					$ 523,740
				Wertsteigerung	$ 813,285
				Wertminderung	$ (289,545)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	EUR	4,065	USD	4,399	06/10/2020	$ (113,411)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	AUD	4,787	USD	3,042	06/11/2020	(149,365)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	CNH	356,478	USD	50,389	06/16/2020	494,391
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	USD	5,157	SGD	7,300	08/27/2020	12,531
Bank of America, NA.	JPY	480,712	USD	4,515	06/05/2020	56,939
Bank of America, NA.	EUR	3,323	USD	3,658	06/10/2020	(31,175)
Bank of America, NA.	USD	5,392	RUB	398,902	07/14/2020	233,651
Bank of America, NA.	CAD	7,005	USD	5,028	08/06/2020	(60,126)
Barclays Bank PLC	USD	9,733	NZD	16,257	06/04/2020	358,573
Barclays Bank PLC	JPY	166,859	USD	1,554	06/05/2020	6,725
Barclays Bank PLC	EUR	2,713	USD	2,940	06/10/2020	(71,559)
Barclays Bank PLC	EUR	79,292	USD	87,125	06/17/2020	(919,492)
Barclays Bank PLC	EUR	22,889	USD	24,750	06/25/2020	(670,217)
Barclays Bank PLC	NOK	84,401	USD	8,255	07/15/2020	(430,923)
Barclays Bank PLC	GBP	1,637	USD	2,011	07/17/2020	(10,980)
Barclays Bank PLC	ZAR	11,708	USD	667	07/17/2020	3,303
Barclays Bank PLC	USD	2,805	INR	220,105	07/23/2020	94,585
BNP Paribas SA	BRL	28,510	USD	5,302	06/02/2020	(41,032)
BNP Paribas SA	JPY	572,438	USD	5,317	06/05/2020	9,166
BNP Paribas SA	EUR	1,055	USD	1,163	06/10/2020	(8,128)
BNP Paribas SA	USD	5,180	AUD	7,862	06/11/2020	59,882
BNP Paribas SA	USD	5,293	BRL	28,510	07/02/2020	40,801
BNP Paribas SA	USD	5,888	IDR	88,053,338	07/23/2020	64,036
BNP Paribas SA	USD	5,156	CHF	4,988	08/28/2020	43,920
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	76,463	USD	718	06/05/2020	9,312
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	6,932	USD	7,509	06/10/2020	(186,575)
Brown Brothers Harriman & Co.	CNH	56,968	USD	7,993	06/16/2020	19,410
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	19,165	AUD	29,583	06/12/2020	554,375
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	52,507	CAD	73,459	06/12/2020	845,943
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	32,159	EUR	29,668	06/12/2020	780,762
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5,988	GBP	4,859	06/12/2020	13,259
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,066	SGD	2,927	06/12/2020	5,745
Citibank, NA	JPY	249,631	USD	2,317	06/05/2020	1,761
Citibank, NA	EUR	12,110	USD	13,090	06/10/2020	(354,929)
Citibank, NA	USD	5,937	EUR	5,437	06/10/2020	99,722
Citibank, NA	AUD	3,200	USD	1,901	06/11/2020	(232,311)
Citibank, NA	MXN	186,268	USD	7,980	06/19/2020	(398,761)
Citibank, NA	BRL	29,536	USD	5,554	07/02/2020	28,160
Citibank, NA	EUR	8,219	USD	8,911	07/07/2020	(218,836)
Citibank, NA	CLP	8,519,844	USD	10,346	07/15/2020	(298,769)
Citibank, NA	COP	38,181,689	USD	9,575	07/15/2020	(621,826)
Citibank, NA	SEK	101,547	USD	10,393	07/15/2020	(388,056)
Citibank, NA	USD	9,912	COP	38,090,360	07/15/2020	259,729
Citibank, NA	USD	5,343	NOK	52,348	07/15/2020	43,533
Citibank, NA	GBP	44,510	USD	54,440	07/17/2020	(539,875)
Citibank, NA	PLN	30,391	USD	7,230	07/29/2020	(345,799)
Citibank, NA	KRW	1,635,686	USD	1,345	08/13/2020	18,317

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Credit Suisse International	USD	19,705	MXN	485,657	06/19/2020	$ 2,139,852
Credit Suisse International	USD	7,527	PLN	30,380	07/29/2020	45,954
Credit Suisse International	SGD	7,303	USD	5,145	08/27/2020	(26,697)
Deutsche Bank AG	USD	13,269	JPY	1,428,612	06/05/2020	(21,983)
Deutsche Bank AG	USD	8,715	EUR	7,965	06/10/2020	128,372
Deutsche Bank AG	EUR	84,350	USD	92,898	07/30/2020	(850,473)
Goldman Sachs Bank USA	NZD	15,997	USD	9,518	06/04/2020	(412,173)
Goldman Sachs Bank USA	MXN	336,748	USD	13,680	06/19/2020	(1,466,795)
Goldman Sachs Bank USA	USD	2,185	SEK	20,990	07/15/2020	43,325
Goldman Sachs Bank USA	CAD	65,881	USD	47,504	08/06/2020	(345,613)
Goldman Sachs Bank USA	KRW	25,186,398	USD	20,555	08/13/2020	120,577
Goldman Sachs Bank USA	MYR	69,544	USD	16,937	08/13/2020	967,373
Goldman Sachs Bank USA	USD	4,834	MYR	20,035	08/13/2020	(233,368)
HSBC Bank USA	CNH	14,613	USD	2,064	06/16/2020	19,038
HSBC Bank USA	USD	5,211	TWD	153,602	08/20/2020	(56,997)
JPMorgan Chase Bank, NA	JPY	1,125,135	USD	10,449	06/05/2020	16,109
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	9,291	JPY	1,001,818	06/05/2020	(909)
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	3,371	USD	3,661	06/10/2020	(81,793)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	3,191	NOK	32,072	07/15/2020	109,098
JPMorgan Chase Bank, NA	ZAR	19,804	USD	1,070	07/17/2020	(52,707)
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR	29,326,639	USD	1,831	07/23/2020	(151,693)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY	6,190,995	USD	56,919	06/05/2020	(489,291)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	6,147	JPY	657,101	06/05/2020	(53,390)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	20,847	USD	22,681	06/10/2020	(464,369)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	2,628	EUR	2,438	06/10/2020	79,264
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	4,526	RUB	338,010	07/14/2020	240,816
Morgan Stanley Capital Services LLC	ZAR	48,258	USD	2,622	07/17/2020	(114,560)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	7,900	MYR	32,750	08/13/2020	(379,890)
Royal Bank of Scotland PLC	CNH	60,055	USD	8,351	06/01/2020	(63,344)
Royal Bank of Scotland PLC	NZD	7,923	USD	4,775	06/04/2020	(143,466)
Royal Bank of Scotland PLC	AUD	7,832	USD	4,708	06/11/2020	(512,817)
Royal Bank of Scotland PLC	USD	8,343	CNH	60,055	06/16/2020	62,197
Royal Bank of Scotland PLC	MXN	51,155	USD	2,154	06/19/2020	(146,482)
Royal Bank of Scotland PLC	EUR	82,392	USD	90,164	07/07/2020	(1,360,920)
Standard Chartered Bank	USD	5,102	BRL	28,510	06/02/2020	240,605
Standard Chartered Bank	USD	4,586	NZD	7,662	06/04/2020	170,093
Standard Chartered Bank	IDR	66,645,085	USD	4,131	07/23/2020	(374,014)
Standard Chartered Bank	INR	216,985	USD	2,858	07/23/2020	(602)
Standard Chartered Bank	USD	5,207	TWD	154,360	08/20/2020	(27,602)
UBS AG	JPY	2,729,709	USD	25,647	06/05/2020	334,768
UBS AG	USD	678	JPY	72,818	06/05/2020	(2,403)
UBS AG	AUD	7,730	USD	4,864	06/11/2020	(288,334)
UBS AG	JPY	1,686,629	USD	15,687	06/25/2020	42,079
UBS AG	USD	1,972	GBP	1,620	07/17/2020	29,301
						$ (5,267,478)
					Wertsteigerung	$ 8,947,352
					Wertminderung	$ (14,214,830)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

VERKAUFTE ZINS-SWAPTIONS

Bezeichnung	Ausübungs-preis	Fälligkeit	Kontrakte (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Call - Interest Rate Swap	USD 0.81	5/29/20	USD 8,630	$ 218,339	$ —
Call - Interest Rate Swap	0.53	6/29/20	38,930	160,002	(232,026)
				$ 378,341	$ (232,026)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal-betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	CAD 7,068	01/14/2050	2.210%	3 Month CDOR	$ (1,038,368)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	33,353	01/14/2025	3 Month CDOR	1.950%	1,354,702
Insgesamt					$ 316,334
				Wertsteigerung	$ 1,354,702
				Wertminderung	$ (1,038,368)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss-datum		Nomineller Betrag (000)	Markt-wert	Vorab-gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte							
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD	44	$ (7,216)	$ 122	$ (7,338)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		111	(37,130)	(13,866)	(23,264)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		159	(53,185)	(19,787)	(33,398)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		269	(89,980)	(37,542)	(52,438)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		408	(136,476)	(47,940)	(88,536)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063		150	(24,600)	(2,806)	(21,794)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		229	(76,601)	(15,847)	(60,754)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		825	(275,963)	(59,168)	(216,795)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		955	(319,448)	(133,893)	(185,555)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063		4,830	(792,120)	(85,245)	(706,875)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		8,482	(2,837,229)	(997,511)	(1,839,718)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063		1,800	(295,200)	(71,128)	(224,072)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		2,128	(711,816)	(300,469)	(411,347)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063		2,176	(356,863)	6,610	(363,473)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		916	(306,402)	(75,659)	(230,743)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063		1	(164)	(18)	(146)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063		3,312	(543,168)	(36,424)	(506,744)
Insgesamt					$ (6,863,561)	$(1,890,571)	$ (4,972,990)
Swaps insgesamt							$ (4,656,656)

(a) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für Derivate zu dienen.

(b) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.

(c) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2020.

(d) Zahlungen in Sachwerten (PIK).

(e) Not leidend.

(f) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
BRL – Brazilian Real
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
CLP – Chilean Peso
COP – Colombian Peso
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY – Chinese Yuan Renminbi
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
IDR – Indonesian Rupiah
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
TWD – New Taiwan Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ABS	–	Asset-Backed Securities
BOBL	–	Bundesobligationen
CAC	–	Cotation Assistée en Continu (Continuous Assisted Quotation)
CBT	–	Chicago Board of Trade
CDOR	–	Canadian Dealer Offered Rate
CDX-CMBX.NA	–	North American Commercial Mortgage-Backed Index
CLO	–	Collateralized Loan Obligations
CMBS	–	Commercial Mortgage-Backed Securities
CPI	–	Consumer Price Index
FHLMC	–	Federal Home Loan Mortgage Corporation
FNMA	–	Federal National Mortgage Association
IRS	–	Interest Rate Swaption
LCH	–	London Clearing House
OSE	–	Osaka Securities Exchange

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONSAUSRÜSTUNG			
Cisco Systems, Inc.	133,143	$ 6,366,898	0.8%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
PayPal Holdings, Inc.	23,564	3,652,656	0.5
Visa, Inc. - Class A	56,364	11,004,507	1.4
		14,657,163	1.9
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Intel Corp.	163,203	10,270,365	1.3
NVIDIA Corp.	13,811	4,903,181	0.7
QUALCOMM, Inc.	50,361	4,073,198	0.5
Texas Instruments, Inc.	31,686	3,762,395	0.5
		23,009,139	3.0
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	9,528	3,683,525	0.5
Microsoft Corp.	173,685	31,827,776	4.1
salesforce.com, Inc.	17,595	3,075,430	0.4
		38,586,731	5.0
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	78,057	24,817,443	3.3
		107,437,374	14.0
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	22,280	6,415,749	0.8
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	43,172	4,097,886	0.5
Baxter International, Inc.	40,803	3,672,678	0.5
Boston Scientific Corp.	160,709	6,105,335	0.8
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	31,286	3,952,673	0.5
		17,828,572	2.3
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Cigna Corp.	35,370	6,979,208	0.9
Humana, Inc.	10,138	4,163,170	0.6
UnitedHealth Group, Inc.	47,903	14,603,230	1.9
		25,745,608	3.4
PHARMAZEUTIKA			
Eli Lilly & Co.	37,680	5,763,156	0.8
Johnson & Johnson	89,122	13,256,897	1.7
Merck & Co., Inc.	183,641	14,823,502	1.9
		33,843,555	4.4
		83,833,484	10.9
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of America Corp.	221,136	5,333,800	0.7
Citigroup, Inc.	82,946	3,973,943	0.5
JPMorgan Chase & Co.	103,574	10,078,786	1.3
PNC Financial Services Group, Inc. (The)	90,159	10,281,733	1.4
		29,668,262	3.9
KAPITALMÄRKTE			
BlackRock, Inc. - Class A	3,698	1,954,911	0.2
Charles Schwab Corp. (The)	141,207	5,070,743	0.7
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	53,722	10,555,836	1.4
		17,581,490	2.3
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Berkshire Hathaway, Inc. - Class B	71,787	13,322,231	1.7
		60,571,983	7.9
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Anterix, Inc.	37,967	2,035,031	0.3
Comcast Corp. - Class A	100,280	3,971,088	0.5
		6,006,119	0.8
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	153,523	11,050,586	1.4
Netflix, Inc.	7,882	3,308,312	0.4
Take-Two Interactive Software, Inc.	2,818	383,727	0.1
Vivendi SA	182,266	4,167,574	0.5

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Walt Disney Co. (The)	30,953	$ 3,630,787	0.5%
		22,540,986	2.9
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	12,887	18,414,492	2.4
Facebook, Inc. - Class A	48,050	10,815,574	1.4
		29,230,066	3.8
		57,777,171	7.5
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
L3Harris Technologies, Inc.	19,488	3,886,881	0.5
Raytheon Technologies Corp.	69,334	4,473,430	0.6
		8,360,311	1.1
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Jacobs Engineering Group, Inc.	128,893	10,829,590	1.4
INDUSTRIEKONZERNE			
Honeywell International, Inc.	139,788	20,388,080	2.7
STRASSE UND SCHIENE			
Norfolk Southern Corp.	31,456	5,608,290	0.7
Union Pacific Corp.	41,516	7,051,908	0.9
		12,660,198	1.6
		52,238,179	6.8
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Starbucks Corp.	27,792	2,167,498	0.3
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	9,542	1,978,915	0.3
Amazon.com, Inc.	8,250	20,149,553	2.6
Booking Holdings, Inc.	1,835	3,008,336	0.4
		25,136,804	3.3
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Target Corp.	11,929	1,459,274	0.2
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Home Depot, Inc. (The)	29,094	7,229,277	0.9
Lowe's Cos., Inc.	41,828	5,452,280	0.7
Ulta Beauty, Inc.	6,980	1,703,190	0.2
		14,384,747	1.8
		43,148,323	5.6
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	60,301	2,814,851	0.4
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Costco Wholesale Corp.	8,805	2,716,078	0.4
Walmart, Inc.	34,178	4,240,123	0.5
		6,956,201	0.9
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The)	232,229	26,919,985	3.5
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Estee Lauder Cos., Inc. (The) - Class A	11,357	2,242,667	0.3
		38,933,704	5.1
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
NextEra Energy, Inc.	57,662	14,736,101	1.9
NRG Energy, Inc.	192,421	6,936,777	0.9
		21,672,878	2.8
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Chevron Corp.	80,670	7,397,439	1.0
EOG Resources, Inc.	120,293	6,131,334	0.8
		13,528,773	1.8
GRUNDSTOFFE			
CONTAINER UND VERPACKUNGEN			
Berry Global Group, Inc.	114,475	5,141,072	0.7
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
Equinix, Inc.	1,787	1,246,665	0.2
QTS Realty Trust, Inc. - Class A	16,073	1,102,608	0.1
		2,349,273	0.3
		486,632,214	63.4

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
GELDMARKTINSTRUMENTE					
US-SCHATZWECHSEL					
U.S. Treasury Bill	0.00%	08/13/2020	USD 54,400	$ 54,385,660	7.1%
U.S. Treasury Bill	0.00%	08/06/2020	50,600	50,587,011	6.6
U.S. Treasury Bill	0.00%	07/28/2020	49,600	49,589,396	6.5
U.S. Treasury Bill	0.00%	07/21/2020	40,100	40,092,481	5.2
U.S. Treasury Bill(a)	0.00%	07/16/2020	25,000	24,995,937	3.2
U.S. Treasury Bill	0.00%	07/09/2020	11,300	11,298,390	1.5
				230,948,875	30.1
				717,581,089	93.5
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
VORZUGSAKTIEN					
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
Honest Co., Inc. (The), Series D (b)			17,234	494,682	0.1
VERBRAUCHSGÜTER					
Dream Holdings, Inc., Series 2 (b)			92,100	499,643	0.1
Dream Holdings, Inc., Series D (b)			326,648	1,360,489	0.1
				1,860,132	0.2
				2,354,814	0.3
Gesamtanlagen					
(Kosten $681,756,490)				$719,935,903	93.8%
Termineinlagen					
BBH, Grand Cayman(c)	0.01 %	–		717	0.0
BBH, Grand Cayman(c)	0.03 %	–		222,400	0.1
HSBC France S.A., Paris(c)	(0.67)%	–		27,935	0.0
Sumitomo, Tokyo(c)	(0.26)%	–		38,823	0.0
Sumitomo, Tokyo(c)	0.01 %	–		62,085,220	8.1
Termineinlagen insgesamt				62,375,095	8.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(15,012,590)	(2.0)
Nettovermögen				$767,298,408	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Short					
S&P 500 E Mini Futures	06/19/2020	73	$ 10,650,147	$ 11,103,300	$ (453,153)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	9	AUD	14	06/12/2020	$ 252
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,741	CHF	2,660	06/12/2020	26,006
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	326,845	EUR	301,507	06/12/2020	7,905,168
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6,661	GBP	5,406	06/12/2020	15,378
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	70,030	JPY	7,518,031	06/12/2020	(310,394)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	9	PLN	39	06/12/2020	439
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,980	SGD	2,805	06/12/2020	5,259
						$ 7,642,108
					Wertsteigerung	$ 7,952,502
					Wertminderung	$ (310,394)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeitsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Acadia Realty Trust	6,292	FedFundEffective minus 0.25%	USD 77	03/05/2021	$ 5,397
Acadia Realty Trust	382	FedFundEffective minus 0.24%	4	03/05/2021	328
Agree Realty Corp.	1,165	FedFundEffective minus 0.25%	73	03/05/2021	444
Agree Realty Corp.	71	FedFundEffective minus 0.24%	4	03/05/2021	27
Alliance Data Systems Corp.	93	FedFundEffective minus 0.24%	4	03/05/2021	(1,142)
Alliance Data Systems Corp.	1,527	FedFundEffective minus 0.25%	55	03/05/2021	(18,744)
Alliance Warren	43,719	FedFundEffective minus 0.50%	4,873	03/05/2021	424,440
American Express Co.	36	FedFundEffective minus 0.24%	3	03/05/2021	(428)

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
American Express Co.	588	FedFundEffective minus 0.25%	USD 49	03/05/2021	$ (6,997)
Avis Budget Group, Inc.	54	FedFundEffective minus 1.45%	1	03/05/2021	(425)
Avis Budget Group, Inc.	221	FedFundEffective minus 1.64%	3	03/05/2021	(1,738)
Avis Budget Group, Inc.	3,584	FedFundEffective minus 0.25%	51	03/05/2021	(28,189)
Brixmor Property Group, Inc.	514	FedFundEffective minus 0.24%	5	03/05/2021	(523)
Brixmor Property Group, Inc.	8,472	FedFundEffective minus 0.25%	85	03/05/2021	(8,623)
Canada Goose Holdings, Inc.	2,442	FedFundEffective minus 2.60%	53	03/05/2021	7,546
Canada Goose Holdings, Inc.	182	FedFundEffective minus 2.00%	4	03/05/2021	562
Canada Goose Holdings, Inc.	162	FedFundEffective minus 1.85%	4	03/05/2021	501
Canada Goose Holdings, Inc.	40	FedFundEffective minus 1.45%	1	03/05/2021	124
Canopy Growth Corp.	55	FedFundEffective minus 15.10%	1	03/05/2021	(133)
Canopy Growth Corp.	468	FedFundEffective minus 15.85%	8	03/05/2021	(1,129)
Canopy Growth Corp.	527	FedFundEffective minus 19.20%	8	03/05/2021	(1,271)
Canopy Growth Corp.	2,815	FedFundEffective minus 20.70%	42	03/05/2021	(6,790)
Capital One Financial Corp.	63	FedFundEffective minus 0.24%	4	03/05/2021	(1,072)
Capital One Financial Corp.	1,042	FedFundEffective minus 0.25%	56	03/05/2021	(17,737)
Chatham Lodging Trust	591	FedFundEffective minus 0.24%	4	03/05/2021	(188)
Chatham Lodging Trust	9,726	FedFundEffective minus 0.25%	65	03/05/2021	(3,099)
Colfax Corp.	157	FedFundEffective minus 0.24%	4	03/05/2021	(1,113)
Colfax Corp.	2,580	FedFundEffective minus 0.25%	57	03/05/2021	(18,291)
Credit Acceptance Corp.	1	FedFundEffective minus 1.45%	0**	03/05/2021	(99)
Credit Acceptance Corp.	4	FedFundEffective minus 0.95%	1	03/05/2021	(397)
Credit Acceptance Corp.	11	FedFundEffective minus 1.29%	4	03/05/2021	(1,090)
Credit Acceptance Corp.	13	FedFundEffective minus 0.94%	4	03/05/2021	(1,288)
Credit Acceptance Corp.	30	FedFundEffective minus 1.20%	9	03/05/2021	(2,973)
Credit Acceptance Corp.	157	FedFundEffective minus 0.75%	44	03/05/2021	(15,558)
Empire State Realty Trust	10,401	FedFundEffective minus 0.25%	91	03/05/2021	22,219
Empire State Realty Trust	631	FedFundEffective minus 0.24%	5	03/05/2021	1,348
Ford Motor Co.	472	FedFundEffective minus 0.24%	2	03/05/2021	(397)
Ford Motor Co.	7,781	FedFundEffective minus 0.25%	39	03/05/2021	(6,543)
Global Payments, Inc.	21	FedFundEffective minus 0.24%	4	03/05/2021	(801)
Global Payments, Inc.	351	FedFundEffective minus 0.25%	51	03/05/2021	(13,381)
HP, Inc.	2,999	FedFundEffective minus 0.25%	46	03/05/2021	1,228
HP, Inc.	182	FedFundEffective minus 0.24%	3	03/05/2021	74
HSBC Holdings PLC	6,000	HIBOR minus 1.38%	238	03/05/2021	6,312
HSBC Holdings PLC	1,067	LIBOR	44	03/05/2021	1,122
HSBC Holdings PLC	400	HIBOR minus 0.75%	15	03/05/2021	421
Intuitive Surgical, Inc.	6	FedFundEffective minus 0.24%	3	03/05/2021	(535)
Intuitive Surgical, Inc.	102	FedFundEffective minus 0.25%	51	03/05/2021	(9,094)
Invesco Ltd.	5,783	FedFundEffective minus 0.25%	52	03/05/2021	5,213
Invesco Ltd.	351	FedFundEffective minus 0.24%	3	03/05/2021	316
Kimco Realty Corp.	503	FedFundEffective minus 0.24%	5	03/05/2021	(563)
Kimco Realty Corp.	8,284	FedFundEffective minus 0.25%	81	03/05/2021	(9,279)
Laboratory Corp Of America Holdings	25	FedFundEffective minus 0.24%	4	03/05/2021	(1,003)
Laboratory Corp Of America Holdings	407	FedFundEffective minus 0.25%	59	03/05/2021	(16,326)
Marriott International	19	FedFundEffective minus 0.24%	2	03/05/2021	(206)
Marriott International	317	FedFundEffective minus 0.25%	26	03/05/2021	(3,439)
Oxford Industries, Inc.	707	FedFundEffective minus 0.25%	28	03/05/2021	450
Oxford Industries, Inc.	43	FedFundEffective minus 0.24%	2	03/05/2021	27
Regency Centers Corp.	127	FedFundEffective minus 0.24%	5	03/05/2021	(237)
Regency Centers Corp.	2,100	FedFundEffective minus 0.25%	86	03/05/2021	(3,911)
Six Flags Entertainment Corp.	175	FedFundEffective minus 0.24%	3	03/05/2021	(1,478)
Six Flags Entertainment Corp.	2,886	FedFundEffective minus 0.25%	45	03/05/2021	(24,375)
Sl Green Realty Corp.	1,885	FedFundEffective minus 0.25%	94	03/05/2021	13,002
Sl Green Realty Corp.	114	FedFundEffective minus 0.24%	5	03/05/2021	786
Snap-On, Inc.	20	FedFundEffective minus 0.24%	2	03/05/2021	(385)
Snap-On, Inc.	328	FedFundEffective minus 0.25%	37	03/05/2021	(6,311)
Stryker Corp.	19	FedFundEffective minus 0.24%	4	03/05/2021	(548)
Stryker Corp.	311	FedFundEffective minus 0.25%	54	03/05/2021	(8,975)
Synchrony Financial	197	FedFundEffective minus 0.24%	3	03/05/2021	(1,023)
Synchrony Financial	3,243	FedFundEffective minus 0.25%	50	03/05/2021	(16,842)
Tanger Factory Outlet Center	12,962	FedFundEffective minus 9.75%	82	03/05/2021	1,090
Tanger Factory Outlet Center	1,593	FedFundEffective minus 17.14%	11	03/05/2021	134
Tanger Factory Outlet Center	210	FedFundEffective minus 14.05%	1	03/05/2021	18
Tesla, Inc.	2	FedFundEffective minus 0.24%	2	03/05/2021	(448)
Tesla, Inc.	22	FedFundEffective minus 0.25%	16	03/05/2021	(4,925)
Washington Prime Group, Inc.	44,944	FedFundEffective minus 7.10%	36	03/05/2021	14,434
Washington Prime Group, Inc.	3,322	FedFundEffective minus 6.44%	3	03/05/2021	1,067
Washington Prime Group, Inc.	2,931	FedFundEffective minus 7.74%	2	03/05/2021	941
Insgesamt					$ 239,509
				Wertsteigerung	$ 509,571
				Wertminderung	$ (270,062)

** Nomineller Betrag geringer als $500.

(a) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für Derivate zu dienen.

(b) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

(c) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CHF – Swiss Franc
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
JPY – Japanese Yen
PLN – Polish Zloty
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
FedFundEffective – Federal Funds Effective Rate
HIBOR – Hong Kong Interbank Offered Rate
LIBOR – London Interbank Offered Rate

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE						
SCHATZOBLIGATIONEN						
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	4.50%	03/01/2026	CLP	2,260,000	$ 3,257,406	1.2%
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	4.70%	09/01/2030		2,365,000	3,617,018	1.3
Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP	22,513,600	6,202,014	2.3
Colombian TES, Series B	6.25%	11/26/2025		19,902,300	5,793,477	2.2
Colombian TES, Series B	7.00%	06/30/2032		20,909,900	5,996,068	2.2
Colombian TES, Series B	7.50%	08/26/2026		4,424,000	1,357,127	0.5
Colombian TES, Series B	7.75%	09/18/2030		5,771,600	1,762,199	0.7
Czech Republic	1.20%	03/13/2031	CZK	125,000	5,354,145	2.0
Hungary Government Bond, Series 25/C	1.00%	11/26/2025	HUF	819,890	2,543,115	0.9
Hungary Government Bond, Series 30/A	3.00%	08/21/2030		2,422,540	8,516,618	3.2
India Government Bond	7.72%	05/25/2025	INR	191,000	2,775,283	1.0
Indonesia Treasury Bond, Series FR65	6.63%	05/15/2033	IDR	69,403,000	4,277,714	1.6
Indonesia Treasury Bond, Series FR68	8.38%	03/15/2034		217,254,000	15,435,294	5.7
Indonesia Treasury Bond, Series FR81	6.50%	06/15/2025		59,665,000	4,016,463	1.5
Malaysia Government Bond, Series 0413	3.84%	04/15/2033	MYR	10,138	2,469,582	0.9
Mexican Bonos, Series M	7.75%	05/29/2031	MXN	54,960	2,744,964	1.0
Mexican Bonos, Series M	7.75%	11/13/2042		124,610	6,049,762	2.2
Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047		78,385	3,916,024	1.5
Mexican Bonos, Series M 20	8.50%	05/31/2029		109,672	5,744,927	2.1
Peru Government Bond	5.94%	02/12/2029	PEN	12,970	4,346,406	1.6
Peru Government Bond	6.90%	08/12/2037		23,003	8,184,226	3.0
Peru Government Bond	8.20%	08/12/2026		7,286	2,746,230	1.0
Republic of Poland Government Bond, Series 1024	2.25%	10/25/2024	PLN	52,833	14,149,610	5.3
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6207	8.15%	02/03/2027	RUB	108,069	1,796,272	0.7
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212	7.05%	01/19/2028		1,003,280	15,860,931	5.9
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6215	7.00%	08/16/2023		68,425	1,036,805	0.4
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6222	7.10%	10/16/2024		378,651	5,834,646	2.2
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6225	7.25%	05/10/2034		258,370	4,199,484	1.6
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6226	7.95%	10/07/2026		438,163	7,179,351	2.7
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6227	7.40%	07/17/2024		155,059	2,409,149	0.9
Thailand Government Bond	3.78%	06/25/2032	THB	207,643	8,113,513	3.0
					167,685,823	62.3
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2023	BRL	70,300	14,946,959	5.6
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2025		39,964	8,703,200	3.2
Egypt Government Bond, Series 10Y	14.40%	09/10/2029	EGP	76,050	4,946,586	1.8
Republic of South Africa Government Bond, Series 2030	8.00%	01/31/2030	ZAR	67,531	3,623,600	1.4
Republic of South Africa Government Bond, Series 2032	8.25%	03/31/2032		102,118	5,219,668	1.9
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048	8.75%	02/28/2048		49,170	2,267,317	0.8
Republic of South Africa Government Bond, Series R213	7.00%	02/28/2031		197,675	9,471,246	3.5
Republic of South Africa Government Bond, Series R214	6.50%	02/28/2041		55,065	2,032,504	0.8
					51,211,080	19.0
QUASI-STAATSANLEIHEN						
China Development Bank, Series 1902	3.03%	01/18/2022	CNY	33,440	4,736,461	1.8
Eskom Holdings SOC Ltd., Series 42	8.50%	04/25/2042	ZAR	106,000	4,395,913	1.6
					9,132,374	3.4
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE						
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP	3,492,680	636,735	0.2
Mexican Udibonos, Series S	4.00%	11/30/2028	MXN	50,997	2,611,003	1.0
Mexican Udibonos, Series S	4.50%	12/04/2025		71,019	3,598,057	1.3
					6,845,795	2.5
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
Empresas Publicas de Medellin ESP	8.38%	11/08/2027	COP	5,810,000	1,577,486	0.6
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR	40,000	524,358	0.2
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022		50,000	628,998	0.2
Petrobras Global Finance BV	6.13%	01/17/2022	USD	1	703	0.0
Wijaya Karya Persero Tbk PT	7.70%	01/31/2021	IDR	38,740,000	2,518,975	1.0
					5,250,520	2.0
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN						
International Bank for Reconstruction & Development	7.45%	08/20/2021		37,000,000	2,514,784	0.9
STAATSANLEIHEN						
Argentine Republic Government International Bond(a)	7.82%	12/31/2033	EUR	1,417	664,626	0.2
STAATLICHE BEHÖRDEN						
National Highways Authority of India	7.30%	05/18/2022	INR	20,000	260,609	0.1

	Zinssatz	Datum	Kontrakte/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettovermögen %
GEKAUFTE KAUFOPTIONEN						
OPTIONEN AUF TERMINKONTRAKTE						
JPY/USD						
Expiration: Aug 2020, Exercise Price: $110.75(b)			642,350,000		$ 173,184	0.1%
MXN/USD						
Expiration: Feb 2021, Exercise Price: $20.00(b)			115,600,000		44,630	0.0
					217,814	0.1
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN						
OPTIONEN AUF TERMINKONTRAKTE						
JPY/USD						
Expiration: Aug 2020, Exercise Price: $110.75(b)			642,350,000		9,333	0.0
					243,792,758	90.5
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
SCHATZOBLIGATIONEN						
Malaysia Government Bond						
Series 0319	3.48%	06/14/2024	MYR	21,740	5,197,473	1.9
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
Ukraine Government Bond	16.75%	06/02/2021	UAH	32,997	1,278,358	0.5
Ukraine Government Bond	17.00%	05/11/2022		35,500	1,423,695	0.5
Ukraine Government Bond	18.00%	03/24/2021		28,000	1,088,057	0.4
					3,790,110	1.4
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
Banco Hipotecario SA(c) (d)	38.33%	11/07/2022	ARS	23,060	168,373	0.1
Digicel Group One Ltd.(a)	8.25%	12/30/2022	USD	243	142,952	0.0
Digicel Group Two Ltd.(a)	8.25%	09/30/2022		304	9,303	0.0
Digicel Group Two Ltd.(a)	9.13%	04/01/2024		203	4,057	0.0
					324,685	0.1
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE						
Fideicomiso PA Costera(c)	6.25%	01/15/2034	COP	500,000	128,686	0.1
					9,440,954	3.5
Gesamtanlagen						
(Kosten $267,751,872)					$253,233,712	94.0%
Termineinlagen						
ANZ, London(e)	0.01 %	–			3,719,735	1.4
Deutsche Bank, Frankfurt(e)	(0.67)%	–			66,229	0.0
Termineinlagen insgesamt					3,785,964	1.4
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					12,309,810	4.6
Nettovermögen					$269,329,486	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	CNH	68,589	USD	9,695	06/16/2020	$ 95,125
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	USD	4,843	CNH	34,448	06/16/2020	(21,522)
Bank of America, NA.	JPY	523,311	USD	4,905	06/05/2020	52,451
Bank of America, NA.	USD	10,192	JPY	1,108,791	06/05/2020	89,224
Bank of America, NA.	USD	2,532	MXN	61,168	06/19/2020	219,478
Bank of America, NA.	USD	1,269	RUB	90,686	07/14/2020	10,111
Bank of America, NA.	USD	4,274	ZAR	78,739	07/17/2020	190,518
Barclays Bank PLC	USD	5,492	NZD	9,344	06/04/2020	308,963
Barclays Bank PLC	JPY	123,779	USD	1,158	06/05/2020	10,320
Barclays Bank PLC	INR	991,227	USD	12,755	07/23/2020	(302,638)
Barclays Bank PLC	USD	5,055	INR	390,959	07/23/2020	94,958
Barclays Bank PLC	HUF	779,926	USD	2,399	07/29/2020	(93,781)
Barclays Bank PLC	USD	3,741	KRW	4,563,167	08/13/2020	(38,668)
Barclays Bank PLC	USD	4,636	MYR	20,447	08/13/2020	59,416
Barclays Bank PLC	TWD	203,220	USD	6,803	08/20/2020	(15,299)
Barclays Bank PLC	USD	2,643	TWD	77,617	08/20/2020	(38,221)
BNP Paribas SA	BRL	31,305	USD	5,821	06/02/2020	(45,054)
BNP Paribas SA	USD	1,246	NZD	2,086	06/04/2020	49,427
BNP Paribas SA	JPY	139,524	USD	1,302	06/05/2020	8,402
BNP Paribas SA	USD	1,282	JPY	139,520	06/05/2020	11,610
BNP Paribas SA	USD	5,335	EUR	4,839	06/10/2020	37,288
BNP Paribas SA	USD	4,970	CNH	35,433	06/16/2020	(10,716)
BNP Paribas SA	USD	2,395	MXN	58,869	06/19/2020	252,590
BNP Paribas SA	USD	5,812	BRL	31,305	07/02/2020	44,801
BNP Paribas SA	COP	7,677,838	USD	1,945	07/15/2020	(104,868)
BNP Paribas SA	ZAR	49,406	USD	2,822	07/17/2020	20,957
BNP Paribas SA	USD	1,883	IDR	29,980,533	07/23/2020	143,912

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
BNP Paribas SA	USD	3,540	INR	275,093	07/23/2020	$ 83,295
BNP Paribas SA	USD	7,155	CHF	6,922	08/28/2020	60,950
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	8,729	USD	355	06/19/2020	(37,334)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	1,036	MXN	24,705	06/19/2020	74,825
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	8,271	USD	449	07/17/2020	(20,309)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	21,572	THB	688,256	08/27/2020	58,486
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	15	EUR	14	06/12/2020	359
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5	SGD	7	06/12/2020	15
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	9	CZK	233	06/30/2020	157
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	9	PLN	37	06/30/2020	58
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5	SGD	7	06/30/2020	20
Citibank, NA	CLP	4,358,170	USD	5,303	07/15/2020	(142,069)
Citibank, NA	COP	7,095,779	USD	1,792	07/15/2020	(102,821)
Citibank, NA	USD	3,634	CLP	3,044,283	07/15/2020	169,602
Citibank, NA	GBP	8,123	USD	9,935	07/17/2020	(98,521)
Citibank, NA	USD	2,489	PLN	10,463	07/29/2020	119,048
Credit Suisse International	NZD	8,251	USD	4,997	06/04/2020	(124,742)
Credit Suisse International	USD	6,016	NZD	9,965	06/04/2020	169,032
Credit Suisse International	USD	3,541	AUD	5,592	06/11/2020	186,156
Credit Suisse International	MXN	92,340	USD	4,008	06/19/2020	(144,968)
Credit Suisse International	USD	4,093	MXN	99,567	06/19/2020	385,945
Credit Suisse International	USD	6,827	PLN	27,552	07/29/2020	41,518
Deutsche Bank AG	PEN	21,818	USD	6,373	07/15/2020	11,020
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,184	BRL	6,636	06/02/2020	59,554
Goldman Sachs Bank USA	NZD	17,398	USD	10,351	06/04/2020	(448,270)
Goldman Sachs Bank USA	USD	622	JPY	66,808	06/05/2020	(2,519)
Goldman Sachs Bank USA	AUD	2,200	USD	1,402	06/11/2020	(64,224)
Goldman Sachs Bank USA	USD	5,170	CNH	36,500	06/16/2020	(61,305)
Goldman Sachs Bank USA	MXN	34,164	USD	1,530	06/19/2020	(6,613)
Goldman Sachs Bank USA	BRL	21,999	USD	4,123	07/02/2020	7,290
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,457	RUB	104,166	07/14/2020	12,597
Goldman Sachs Bank USA	USD	5,442	MYR	22,343	08/13/2020	(310,795)
HSBC Bank USA	USD	4,284	KRW	5,291,310	08/13/2020	8,933
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	2,191	USD	2,383	06/10/2020	(49,435)
JPMorgan Chase Bank, NA	AUD	2,058	USD	1,276	06/11/2020	(96,028)
JPMorgan Chase Bank, NA	COP	4,146,480	USD	1,060	07/15/2020	(46,963)
JPMorgan Chase Bank, NA	ZAR	107,122	USD	5,789	07/17/2020	(285,099)
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR	25,472,604	USD	1,639	07/23/2020	(82,750)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	6,654	CZK	169,040	07/29/2020	321,564
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	5,916	BRL	33,507	06/02/2020	363,430
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY	258,703	USD	2,432	06/05/2020	33,104
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	2,299	EUR	2,106	06/10/2020	39,327
Morgan Stanley Capital Services LLC	RUB	497,158	USD	6,658	07/14/2020	(354,201)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,875	PEN	6,505	07/15/2020	21,637
Morgan Stanley Capital Services LLC	ZAR	35,200	USD	1,986	07/17/2020	(9,608)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	9,956	SGD	14,090	08/27/2020	20,563
Royal Bank of Scotland PLC	COP	17,334,019	USD	4,350	07/15/2020	(278,647)
Standard Chartered Bank	BRL	13,161	USD	2,313	06/02/2020	(153,105)
Standard Chartered Bank	USD	4,114	BRL	23,174	06/02/2020	228,632
Standard Chartered Bank	AUD	9,236	USD	5,601	06/11/2020	(555,156)
Standard Chartered Bank	USD	1,282	MXN	31,102	06/19/2020	116,800
Standard Chartered Bank	IDR	94,319,805	USD	6,051	07/23/2020	(324,719)
Standard Chartered Bank	INR	214,047	USD	2,785	07/23/2020	(34,704)
Standard Chartered Bank	USD	2,342	IDR	37,543,947	07/23/2020	195,660
Standard Chartered Bank	USD	5,179	INR	398,152	07/23/2020	66,096
Standard Chartered Bank	USD	2,779	KRW	3,406,837	08/13/2020	(14,722)
Standard Chartered Bank	USD	10,856	TWD	320,716	08/20/2020	(94,350)
Standard Chartered Bank	SGD	6,567	USD	4,613	08/27/2020	(37,147)
UBS AG	BRL	18,851	USD	3,341	06/02/2020	(191,648)
UBS AG	USD	1,270	AUD	2,011	06/11/2020	70,218
UBS AG	CNH	20,066	USD	2,845	06/16/2020	36,229
						$ (181,868)
					Wertsteigerung	$ 4,661,671
					Wertminderung	$ (4,843,539)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

VERKAUFTE WÄHRUNGSOPTIONEN

Bezeichnung	Ausübungs-preis	Fälligkeit	Kontrakte (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Goldman Sachs Bank USA - Call - JPY vs. USD (b)	JPY 110.75	Aug 2020	JPY 642,350	$ 534,754	$ (173,183)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Kontrahent	Nomineller Betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	MXN 133,665	05/09/2025	4 Week TIIE	5.090%	$ (51,457)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	INR 206,000	02/14/2025	5.070%	1 Day MIBOR	(117,386)
Insgesamt					$ (168,843)

(a) Not leidend.

(b) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.

(c) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

(d) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2020.

(e) Tagesgeld.

Währungskürzel:

ARS – Argentine Peso
AUD – Australian Dollar
BRL – Brazilian Real
CHF – Swiss Franc
CLP – Chilean Peso
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY – Chinese Yuan Renminbi
COP – Colombian Peso
CZK – Czech Koruna
EGP – Egyptian Pound
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
PEN – Peruvian Sol
PLN – Polish Zloty
RUB – Russian Ruble
SGD – Singapore Dollar
THB – Thailand Baht
TWD – New Taiwan Dollar
UAH – Ukrainian Hryvnia
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

CME – Chicago Mercantile Exchange
LCH – London Clearing House
MIBOR – Mumbai Inter Bank Offered Rate
TIIE – Banco de México Equilibrium Interbank Interest Rate

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
INDIEN					
India Government Bond	7.17%	01/08/2028	INR 83,000	$ 1,168,995	6.5%
India Government Bond	7.59%	03/20/2029	144,500	2,097,280	11.7
				3,266,275	18.2
INDONESIEN					
Indonesia Treasury Bond, Series FR68	8.38%	03/15/2034	IDR 20,230,000	1,437,285	8.0
Indonesia Treasury Bond, Series FR73	8.75%	05/15/2031	18,400,000	1,357,646	7.5
				2,794,931	15.5
MALAYSIA					
Malaysia Government Bond, Series 0316	3.90%	11/30/2026	MYR 800	197,331	1.1
Malaysia Government Bond, Series 0413	3.84%	04/15/2033	1,200	292,316	1.6
				489,647	2.7
PHILIPPINEN					
Philippine Government Bond, Series 1064	6.88%	01/10/2029	PHP 41,000	1,043,347	5.8
Philippine Government International Bond	6.25%	01/14/2036	18,000	421,628	2.3
				1,464,975	8.1
SINGAPUR					
Singapore Government Bond	2.75%	03/01/2046	SGD 610	577,013	3.2
Singapore Government Bond	2.88%	09/01/2030	640	540,068	3.0
				1,117,081	6.2
SÜDKOREA					
Korea Treasury Bond, Series 2912	1.38%	12/10/2029	KRW 972,000	785,320	4.4
Korea Treasury Bond, Series 4903	2.00%	03/10/2049	337,000	297,451	1.6
				1,082,771	6.0
THAILAND					
Thailand Government Bond	2.88%	12/17/2028	THB 15,750	561,826	3.1
Thailand Government Bond	3.30%	06/17/2038	13,600	534,981	3.0
				1,096,807	6.1
				11,312,487	62.8
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - China Bond - Class SA			114,766	1,670,486	9.3
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
CHINA					
China Development Bank, Series 1904	3.68%	02/26/2026	CNY 10,000	1,441,803	8.0
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
FINANZINSTITUTE					
REITS					
China Evergrande Group	8.25%	03/23/2022	USD 200	180,812	1.0
Yuzhou Properties Co., Ltd.	6.00%	10/25/2023	200	187,443	1.0
				368,255	2.0
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Wijaya Karya Persero Tbk PT	7.70%	01/31/2021	IDR 5,120,000	332,916	1.9
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	USD 181	174,371	1.0
				875,542	4.9
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE					
THAILAND					
Thailand Government Bond, Series ILB	1.25%	03/12/2028	THB 17,844	488,964	2.7
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
VIETNAM					
Viet Nam Debt & Asset Trading Corp.	1.00%	10/10/2025	USD 400	302,750	1.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
REITS					
Franshion Brilliant Ltd.	5.20%	03/08/2021	CNH 1,000	141,562	0.8
				16,233,594	90.2
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
Export-Import Bank of India, Series P-06	9.10%	06/15/2022	INR 50,000	706,232	3.9

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Gesamtanlagen					
(Kosten $17,319,518)				$ 16,939,826	94.1%
Termineinlagen					
ANZ, London(a)	0.01 %	–		572,824	3.2
BBH, Grand Cayman(a)	0.01 %	–		554	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	0.04 %	–		50	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	2.75 %	–		385	0.0
Termineinlagen insgesamt				573,813	3.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				482,194	2.7
Nettovermögen				$ 17,995,833	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Korea 3 Yr Bond Futures	06/16/2020	24	$ 2,159,797	$ 2,173,362	$ 13,565
Korea 10 Yr Bond Futures	06/16/2020	16	1,704,841	1,728,871	24,030
					$ 37,595

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	CNY	516	USD	72	06/11/2020	$ (240)
Barclays Bank PLC	IDR	1,574,734	USD	98	07/23/2020	(8,549)
Barclays Bank PLC	MYR	922	USD	215	08/13/2020	3,269
Barclays Bank PLC	USD	312	MYR	1,320	08/13/2020	(44,106)
Barclays Bank PLC	USD	732	MYR	3,044	08/13/2020	2,002
BNP Paribas SA	USD	398	CNH	2,843	06/03/2020	(116)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	470	SGD	666	08/27/2020	976
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	70	THB	2,232	08/27/2020	159
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,809	AUD	4,345	06/12/2020	86,944
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	584	CAD	818	06/12/2020	9,647
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,027	EUR	947	06/12/2020	24,928
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,957	GBP	2,400	06/12/2020	6,954
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	137	SGD	194	06/12/2020	340
Citibank, NA	CNH	6,608	USD	930	06/03/2020	4,414
Citibank, NA	INR	212,681	USD	2,722	07/23/2020	(79,462)
Citibank, NA	USD	1,538	KRW	1,881,310	08/13/2020	(11,668)
Citibank, NA	USD	878	SGD	1,242	08/27/2020	1,179
Deutsche Bank AG	INR	69,831	USD	916	07/23/2020	(4,294)
Goldman Sachs Bank USA	INR	21,951	USD	285	07/23/2020	(4,115)
Goldman Sachs Bank USA	MYR	2,052	USD	500	08/13/2020	28,548
Goldman Sachs Bank USA	PHP	28,971	USD	567	08/19/2020	(3,965)
HSBC Bank USA	USD	115	CNY	814	06/11/2020	(977)
HSBC Bank USA	IDR	3,668,008	USD	232	07/23/2020	(15,844)
HSBC Bank USA	THB	17,423	USD	546	08/27/2020	(1,404)
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR	2,234,292	USD	144	07/23/2020	(7,332)
JPMorgan Chase Bank, NA	SGD	777	USD	548	08/27/2020	(2,161)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	735	IDR	11,763,850	07/23/2020	59,932
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	747	MYR	3,230	08/13/2020	(5,815)
Royal Bank of Scotland PLC	USD	104	INR	8,066	07/23/2020	2,217
Standard Chartered Bank	CNY	2,891	USD	408	06/11/2020	1,623
UBS AG	USD	64	CNH	450	06/03/2020	(582)
UBS AG	USD	535	INR	41,500	07/23/2020	11,740
						$ 54,242
					Wertsteigerung	$ 244,872
					Wertminderung	$ (190,630)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZINSSWAPS

Kontrahent	Nomineller Betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	INR 82,000	04/02/2024	5.810%	1 Day MIBOR	$ (70,979)
Morgan Stanley & Co. LLC.	88,000	02/14/2025	5.070%	1 Day MIBOR	(50,145)
Insgesamt					$ (121,124)

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY – Chinese Yuan Renminbi
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
IDR – Indonesian Rupiah
INR – Indian Rupee
KRW – South Korean Won
MYR – Malaysian Ringgit
PHP – Philippine Peso
SGD – Singapore Dollar
THB – Thailand Baht
USD – United States Dollar

Glossar:

MIBOR – Mumbai Inter Bank Offered Rate
REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
ABJA Investment Co. Pte Ltd.	5.45%	01/24/2028	USD 200	$ 179,094	0.2%
Adani Transmission Ltd.	4.00%	08/03/2026	336	328,650	0.3
ADIB Capital Invest 2 Ltd.(a)	7.13%	09/20/2023	400	419,250	0.4
AES El Salvador Trust II	6.75%	03/28/2023	200	167,000	0.2
AES Gener SA	6.35%	10/07/2079	750	717,487	0.7
Aldar Sukuk No 2 Ltd.	3.88%	10/22/2029	390	394,997	0.4
Alfa SAB de CV	5.25%	03/25/2024	630	647,128	0.6
Almarai Sukuk Ltd.	4.31%	03/05/2024	200	209,125	0.2
Alpek SAB de CV	4.25%	09/18/2029	460	449,880	0.4
Alpek SAB de CV	4.50%	11/20/2022	510	525,040	0.5
Altice Financing SA.	7.50%	05/15/2026	295	310,442	0.3
AngloGold Ashanti Holdings PLC	5.13%	08/01/2022	320	333,800	0.3
AngloGold Ashanti Holdings PLC	6.50%	04/15/2040	736	810,418	0.8
Axtel SAB de CV.	6.38%	11/14/2024	698	699,370	0.7
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	201	214,568	0.2
Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands.	7.75%	02/15/2029	494	467,571	0.5
Banco Internacional del Peru SAA Interbank	3.25%	10/04/2026	200	199,250	0.2
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025	312	333,762	0.3
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	3.73%	09/25/2034	865	812,830	0.8
Bank Leumi Le-Israel BM	3.28%	01/29/2031	700	663,296	0.7
Bank of East Asia Ltd. (The)(a)	5.88%	09/19/2024	250	238,750	0.2
Bank Rakyat Indonesia Persero Tbk PT	3.95%	03/28/2024	400	402,875	0.4
Becle SAB de CV	3.75%	05/13/2025	237	241,296	0.2
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.	0.00%	06/05/2034	225	153,844	0.2
BPRL International Singapore Pte Ltd.	4.38%	01/18/2027	520	523,900	0.5
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	987	895,209	0.9
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	1,327	1,149,514	1.1
Braskem Netherlands Finance BV	5.88%	01/31/2050	287	251,529	0.2
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	641	608,350	0.6
BRF SA	4.88%	01/24/2030	580	535,050	0.5
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	200	198,106	0.2
Cable Onda SA.	4.50%	01/30/2030	280	272,391	0.3
Canacol Energy Ltd.	7.25%	05/03/2025	405	398,672	0.4
Celulosa Arauco y Constitucion SA.	4.20%	01/29/2030	424	424,473	0.4
Celulosa Arauco y Constitucion SA.	4.25%	04/30/2029	321	324,443	0.3
Cemex SAB de CV	5.45%	11/19/2029	280	260,766	0.3
Cemig Geracao e Transmissao SA	9.25%	12/05/2024	793	851,856	0.8
Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.63%	02/04/2025	280	260,680	0.3
Centrais Eletricas Brasileiras SA	4.63%	02/04/2030	254	223,250	0.2
China CITIC Bank International Ltd.(a)	7.10%	11/06/2023	750	795,000	0.8
CK Hutchison International 19 II Ltd.	2.75%	09/06/2029	264	274,932	0.3
CMB Wing Lung Bank Ltd.(a)	6.50%	01/24/2024	770	779,144	0.8
Colbun SA	3.15%	03/06/2030	550	536,401	0.5
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025	200	168,969	0.2
Consorcio Transmantaro SA	4.70%	04/16/2034	320	346,000	0.3
Country Garden Holdings Co., Ltd.	8.00%	01/27/2024	400	430,398	0.4
CSN Islands XI Corp.	6.75%	01/28/2028	250	193,000	0.2
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023	620	528,550	0.5
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	1,388	1,131,003	1.1
DBS Group Holdings Ltd., Series G(a)	3.30%	02/27/2025	200	194,000	0.2
Delek & Avner Tamar Bond Ltd.	5.41%	12/30/2025	400	376,000	0.4
Digicel Group One Ltd.(b)	8.25%	12/30/2022	741	436,448	0.4
Digicel International Finance Ltd./Digicel Holdings Bermuda Ltd.	8.00%	12/31/2026	95	54,949	0.1
Digicel International Finance Ltd./Digicel Holdings Bermuda Ltd.	8.75%	05/25/2024	237	227,830	0.2
Digicel International Finance Ltd./Digicel Holdings Bermuda Ltd.(c)	13.00%	12/31/2025	120	104,578	0.1
Digicel Ltd.	6.75%	03/01/2023	230	104,075	0.1
DP World Crescent Ltd.	3.75%	01/30/2030	238	224,719	0.2
DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029	679	649,930	0.6
DP World Crescent Ltd.	4.85%	09/26/2028	575	590,094	0.6
Ecopetrol SA	4.13%	01/16/2025	400	405,400	0.4
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045	943	984,256	1.0
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	337	306,498	0.3
Emirates Semb Corp. Water & Power Co. PJSC	4.45%	08/01/2035	260	285,188	0.3
Empresa Electrica Angamos SA	4.88%	05/25/2029	290	293,144	0.3
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	665	671,999	0.7
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	398	390,413	0.4
Enel Americas SA	4.00%	10/25/2026	300	316,219	0.3
Enel Chile SA.	4.88%	06/12/2028	384	426,816	0.4
Enel Generacion Chile SA	4.25%	04/15/2024	285	298,805	0.3
Energuate Trust	5.88%	05/03/2027	581	559,793	0.6
Equate Petrochemical BV	4.25%	11/03/2026	652	647,120	0.6
Federal International Finance PT	4.13%	05/10/2021	200	198,375	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
Fenix Power Peru SA	4.32%	09/20/2027	USD	388	$ 381,458	0.4%
Fidelity Bank PLC	10.50%	10/16/2022		240	234,900	0.2
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	04/01/2023		419	386,004	0.4
First Quantum Minerals Ltd.	7.50%	04/01/2025		473	428,477	0.4
FPC Treasury Ltd.	4.50%	04/16/2023		270	270,713	0.3
Fresnillo PLC	5.50%	11/13/2023		340	366,044	0.4
Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA.	4.95%	03/23/2027		1,295	1,437,450	1.4
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027		936	776,587	0.8
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030		986	848,946	0.8
Gohl Capital Ltd.	4.25%	01/24/2027		340	334,262	0.3
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.	6.25%	02/15/2025		1,360	336,932	0.3
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027		855	210,271	0.2
Grupo Aval Ltd.	4.38%	02/04/2030		330	299,700	0.3
Grupo Energia Bogota SA ESP	4.88%	05/15/2030		254	270,777	0.3
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030		328	306,524	0.3
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026		200	181,375	0.2
HTA Group Ltd./Mauritius	9.13%	03/08/2022		500	501,875	0.5
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026		360	381,208	0.4
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.00%	11/19/2025		200	215,438	0.2
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028		335	303,751	0.3
Hyundai Capital America	3.50%	11/02/2026		750	732,859	0.7
Hyundai Capital America	5.88%	04/07/2025		450	493,373	0.5
ICICI Bank Ltd./Dubai	3.25%	09/09/2022		275	276,720	0.3
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR	20,000	251,599	0.2
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	USD	704	732,380	0.7
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	4.88%	01/14/2048		626	554,792	0.5
Intercorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027		790	772,472	0.8
Intercorp Peru Ltd.	3.88%	08/15/2029		427	406,451	0.4
Inversiones CMPC SA	3.85%	01/13/2030		330	332,269	0.3
Inversiones CMPC SA	4.38%	04/04/2027		456	479,370	0.5
Jababeka International BV	6.50%	10/05/2023		360	274,725	0.3
Kaisa Group Holdings Ltd.	9.38%	06/30/2024		290	254,571	0.3
Kallpa Generacion SA	4.13%	08/16/2027		785	771,262	0.8
Kasikornbank PCL/Hong Kong	3.34%	10/02/2031		320	296,900	0.3
Kenbourne Invest SA	6.88%	11/26/2024		1,006	1,003,485	1.0
Kookmin Bank, Series G	4.50%	02/01/2029		200	223,459	0.2
Kosmos Energy Ltd.	7.13%	04/04/2026		920	744,050	0.7
Kwg Property Holding Ltd.	6.00%	09/15/2022		210	207,375	0.2
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	7.25%	05/03/2023		835	826,650	0.8
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036		251	261,417	0.3
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034		418	478,396	0.5
LLPL Capital Pte Ltd.	6.88%	02/04/2039		385	405,068	0.4
MAF Sukuk Ltd.	4.64%	05/14/2029		305	308,553	0.3
Malayan Banking Bhd	3.91%	10/29/2026		560	568,400	0.6
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026		245	205,877	0.2
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027		450	449,787	0.4
Metinvest BV	7.75%	04/23/2023		380	349,481	0.3
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024		500	498,599	0.5
Millicom International Cellular SA	5.13%	01/15/2028		570	554,458	0.5
Mongolian Mining Corp./Energy Resources LLC	9.25%	04/15/2024		620	339,450	0.3
MTN Mauritius Investment Ltd.	6.50%	10/13/2026		400	414,562	0.4
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034		266	245,603	0.2
NBK Tier 1 Financing 2 Ltd.(a)	4.50%	11/27/2025		600	541,200	0.5
NBM US Holdings, Inc.	6.63%	08/06/2029		512	515,330	0.5
NBM US Holdings, Inc.	7.00%	05/14/2026		400	404,407	0.4
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027		1,010	964,550	1.0
OCP SA	4.50%	10/22/2025		300	299,625	0.3
OCP SA	6.88%	04/25/2044		230	258,606	0.3
Odebrecht Finance Ltd.(b)	4.38%	04/25/2025		785	13,492	0.0
Odebrecht Finance Ltd.(b)	5.25%	06/27/2029		217	8,680	0.0
Ooredoo International Finance Ltd.	5.00%	10/19/2025		640	719,200	0.7
Orbia Advance Corp. SAB de CV	4.88%	09/19/2022		400	412,288	0.4
Orbia Advance Corp. SAB de CV	6.75%	09/19/2042		400	446,625	0.4
Oztel Holdings SPC Ltd.	5.63%	10/24/2023		680	652,800	0.6
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030		821	578,292	0.6
Petkim Petrokimya Holding AS	5.88%	01/26/2023		560	535,675	0.5
Petrobras Global Finance BV	5.09%	01/15/2030		740	707,859	0.7
Petrobras Global Finance BV	6.75%	01/27/2041		560	558,775	0.6
Petrobras Global Finance BV	6.85%	06/05/2115		523	488,538	0.5
Petrobras Global Finance BV	7.38%	01/17/2027		224	244,254	0.2
Philippine National Bank	3.28%	09/27/2024		300	298,510	0.3
Powerchina Real Estate Group Ltd.	4.50%	12/06/2021		300	310,090	0.3
Prosus NV	3.68%	01/21/2030		994	1,028,945	1.0
Prosus NV	4.85%	07/06/2027		223	248,504	0.2
Redsun Properties Group Ltd.	9.95%	04/11/2022		200	197,151	0.2
Ronshine China Holdings Ltd.	10.50%	03/01/2022		200	210,188	0.2

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
	Royal Capital BV(a)	5.88%	05/05/2022	USD	400	$	390,500	0.4%
	SABIC Capital II BV	4.50%	10/10/2028		207		227,312	0.2
	Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027		620		626,351	0.6
	Sands China Ltd.	4.60%	08/08/2023		475		494,009	0.5
	Sasol Financing International Ltd.	4.50%	11/14/2022		350		294,892	0.3
	SEPLAT Petroleum Development Co. PLC	9.25%	04/01/2023		370		312,187	0.3
	Shinhan Financial Group Co., Ltd.	3.34%	02/05/2030		290		297,794	0.3
	SK Hynix, Inc.	3.00%	09/17/2024		200		205,875	0.2
	SM Investments Corp.	4.88%	06/10/2024		600		627,966	0.6
	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033		363		348,741	0.3
	Stillwater Mining Co.	7.13%	06/27/2025		1,615		1,663,474	1.7
	SURA Asset Management SA	4.88%	04/17/2024		495		518,512	0.5
	Suzano Austria GmbH	5.00%	01/15/2030		270		264,692	0.3
	Suzano Austria GmbH	6.00%	01/15/2029		245		258,182	0.3
	Tencent Holdings Ltd.	2.39%	06/03/2030		400		398,123	0.4
	Teva Pharmaceutical Finance Co. BV, Series 2	3.65%	11/10/2021		300		296,437	0.3
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.13%	01/31/2025		400		430,423	0.4
	Thaioil Treasury Center Co., Ltd.	4.63%	11/20/2028		297		322,895	0.3
	Tianqi Finco Co., Ltd.	3.75%	11/28/2022		1,218		426,300	0.4
	TMB Bank PCL/Cayman Islands(a)	4.90%	12/02/2024		400		359,375	0.4
	TNB Global Ventures Capital Bhd.	3.24%	10/19/2026		390		411,816	0.4
	TransJamaican Highway Ltd.	5.75%	10/10/2036		421		392,714	0.4
	Transportadora de Gas del Peru SA	4.25%	04/30/2028		300		320,156	0.3
	Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030		216		186,773	0.2
	Turkiye Garanti Bankasi AS	6.13%	05/24/2027		436		396,351	0.4
	Ultrapar International SA	5.25%	10/06/2026		200		195,750	0.2
	Ultrapar International SA	5.25%	06/06/2029		364		346,141	0.3
	Union Bank of the Philippines	3.37%	11/29/2022		600		616,734	0.6
	United Overseas Bank Ltd.(a)	3.88%	10/19/2023		600		601,687	0.6
	Vf Ukraine Pat Via Vfu Funding	6.20%	02/11/2025		203		197,481	0.2
	Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024		330		337,526	0.3
	Wijaya Karya Persero Tbk PT	7.70%	01/31/2021	IDR	12,060,000		784,172	0.8
	Woori Bank	4.75%	04/30/2024	USD	225		240,961	0.2
	Woori Bank	5.13%	08/06/2028		200		229,621	0.2
	Woori Bank(a)	5.25%	05/16/2022		400		404,250	0.4
	YPF SA	8.50%	07/28/2025		200		129,950	0.1
							79,414,770	78.0
STAATSANLEIHEN								
	Abu Dhabi Government International Bond	3.88%	04/16/2050		270		307,462	0.3
	Argentine Republic Government International Bond(b)	3.88%	01/15/2022	EUR	165		68,627	0.1
	Argentine Republic Government International Bond(b)	5.63%	01/26/2022	USD	279		110,205	0.1
	Argentine Republic Government International Bond(b)	5.88%	01/11/2028		269		97,513	0.1
	Argentine Republic Government International Bond(b)	6.63%	07/06/2028		748		269,514	0.3
	Argentine Republic Government International Bond(b)	6.88%	01/26/2027		4,046		1,466,675	1.4
	Argentine Republic Government International Bond(b)	6.88%	01/11/2048		5,327		1,887,756	1.9
	Argentine Republic Government International Bond(b)	7.13%	06/28/2117		238		84,118	0.1
	Argentine Republic Government International Bond(b)	7.50%	04/22/2026		538		203,431	0.2
	Argentine Republic Government International Bond(b)	7.82%	12/31/2033	EUR	98		45,826	0.0
	Argentine Republic Government International Bond, Series NY(b)	3.75%	12/31/2038	USD	515		194,895	0.2
	Ecuador Government International Bond(b)	7.78%	01/23/2028		635		224,155	0.2
	Ecuador Government International Bond(b)	8.88%	10/23/2027		1,080		390,960	0.4
	Ecuador Government International Bond(b)	9.50%	03/27/2030		467		169,755	0.2
	Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050		497		490,787	0.5
	El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025		122		99,621	0.1
	El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027		126		103,005	0.1
	Mexico Government International Bond	5.00%	04/27/2051		327		351,525	0.3
	Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049		400		326,000	0.3
	Russian Foreign Bond - Eurobond	5.25%	06/23/2047		200		269,750	0.3
	Saudi Government International Bond	3.25%	10/22/2030		520		538,200	0.5
	Saudi Government International Bond	3.75%	01/21/2055		450		443,812	0.4
	Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032		600		571,500	0.6
	Ukraine Government International Bond, Series GDP(d)	0.00%	05/31/2040		622		526,951	0.5
							9,242,043	9.1
QUASI-STAATSANLEIHEN								
	Abu Dhabi Crude Oil Pipeline LLC	4.60%	11/02/2047		200		229,500	0.2
	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.	6.00%	11/18/2048		281		290,404	0.3
	Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024		133		129,098	0.1
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	3.88%	06/19/2029		260		273,650	0.3
	CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	4.13%	07/19/2027		417		439,805	0.4
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.15%	01/14/2030		270		279,028	0.3
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031		244		261,080	0.3
	Empresa de Transmision Electrica SA.	5.13%	05/02/2049		210		228,047	0.2
	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	3.65%	05/07/2030		205		219,196	0.2
	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	4.70%	05/07/2050		553		633,461	0.6
	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	5.00%	01/25/2047		274		314,501	0.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettovermögen %
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	USD	625	$ 565,723	0.6%
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025		226	235,255	0.2
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030		418	447,657	0.4
Leader Goal International Ltd.(a)	4.25%	01/19/2023		200	200,563	0.2
MDGH - GMTN BV, Series G.	2.88%	05/21/2030		290	300,148	0.3
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.38%	07/19/2022		240	234,150	0.2
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2026		200	183,375	0.2
Pertamina Persero PT.	4.15%	02/25/2060		200	192,020	0.2
Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027		250	220,781	0.2
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060		864	660,096	0.7
Petronas Capital Ltd.	4.55%	04/21/2050		214	263,915	0.3
SPIC 2018 USD Senior Perpetual Bond Co., Ltd.(a)	5.80%	05/21/2022		200	206,438	0.2
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025		340	341,699	0.3
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027		660	568,425	0.6
					7,918,015	7.8
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE						
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP	897,835	163,680	0.2
STAMMAKTIEN						
Frontera Energy Corp.				5,250	13,460	0.0
					96,751,968	95.1
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
Digicel Group Two Ltd.(b)	8.25%	09/30/2022	USD	922	28,217	0.0
Digicel Group Two Ltd.(b)	9.13%	04/01/2024		558	11,157	0.0
First Quantum Minerals Ltd.	6.88%	03/01/2026		440	394,812	0.4
Frontera Energy Corp.	9.70%	06/25/2023		480	330,000	0.3
Inversiones CMPC SA/Cayman Islands Branch	4.38%	05/15/2023		203	210,993	0.2
Minsur SA	6.25%	02/07/2024		250	266,547	0.3
Odebrecht Finance Ltd.(b)	7.13%	06/26/2042		2,504	42,255	0.0
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.	0.00%	09/30/2036		200	126,569	0.1
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	4.25%	05/07/2029		211	220,759	0.2
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	4.25%	01/22/2050		200	183,562	0.2
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026		380	382,406	0.4
Tonon Luxembourg SA(c) (e)	6.50%	10/31/2024		524	15,760	0.0
Transelec SA	4.25%	01/14/2025		330	348,872	0.3
USJ-Acucar e Alcool S/A(c)	9.88%	11/09/2023		1,238	363,602	0.4
Virgolino de Oliveira Finance SA(f)	10.50%	01/28/2018		818	6,949	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(f)	10.88%	01/13/2020		200	53,250	0.1
Virgolino de Oliveira Finance SA(b)	11.75%	02/09/2022		450	4,229	0.0
YPF SA	7.00%	12/15/2047		200	114,125	0.1
					3,104,064	3.0
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE						
Fideicomiso PA Costera(e).	6.25%	01/15/2034	COP	877,400	225,819	0.2
					3,329,883	3.2
Gesamtanlagen						
(Kosten $110,763,718).					$ 100,081,851	98.3%
Termineinlagen						
ANZ, London(g)	0.01 %	–			2,506,806	2.5
BBH, Grand Cayman(g)	0.04 %	–			1,176	0.0
BBH, Grand Cayman(g)	2.75 %	–			106	0.0
Termineinlagen insgesamt					2,508,088	2.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					(811,288)	(0.8)
Nettovermögen					$ 101,778,651	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC Wholesale	RUB	107,780	USD	1,514	07/14/2020	$ (6,011)
Barclays Bank PLC Wholesale	INR	54,337	USD	695	07/23/2020	(20,435)
Barclays Bank PLC Wholesale	USD	449	INR	34,262	07/23/2020	2,166
BNP Paribas SA	IDR	11,579,977	USD	727	07/23/2020	(55,586)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	68	USD	73	06/10/2020	(1,947)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	23	AUD	36	06/12/2020	664
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	18	CAD	25	06/12/2020	291
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	82	EUR	75	06/12/2020	1,966
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	84	GBP	68	06/12/2020	219
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10	NZD	16	06/12/2020	199
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	32	SGD	45	06/12/2020	92
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	12	CNH	86	06/22/2020	(67)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	2,347	RUB	175,254	07/14/2020	$ 124,860
Royal Bank of Scotland PLC	RUB	66,745	USD	914	07/14/2020	(27,799)
Royal Bank of Scotland PLC	COP	1,788,600	USD	449	07/15/2020	(28,752)
						$ (10,140)
					Wertsteigerung	$ 130,457
					Wertminderung	$ (140,597)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)		Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte						
Citigroup Global Markets Inc./(INTRCONX)	CDX - EM Series 33, 5 Yr	06/20/2025	USD	2,190	$ 194,824	$ (53,505)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets Inc./(INTRCONX)	Republic of Turkey	06/20/2025		650	(126,377)	3,282
Insgesamt					$ 68,447	$ (50,223)
					Wertsteigerung	$ 3,282
					Wertminderung	$ (53,505)

(a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.

(b) Not leidend.

(c) Zahlungen in Sachwerten (PIK).

(d) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. Mai 2020.

(e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

(f) Not leidendes fälliges Wertpapier.

(g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
COP – Colombian Peso
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
IDR – Indonesian Rupiah
INR – Indian Rupee
NZD – New Zealand Dollar
RUB – Russian Ruble
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

CDX - EM – Emerging Market Credit Default Swap Index
CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
PJSC – Public Joint Stock Company

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE							
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT							
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
Advanced Drainage Systems, Inc.	5.00%	09/30/2027	USD	43	$	43,195	0.0%
Alcoa Nederland Holding BV	6.75%	09/30/2024		200		205,497	0.2
Arconic Corp.	6.13%	02/15/2028		167		162,354	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043		261		275,910	0.2
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034		37		38,945	0.0
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044		152		164,755	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026		16		14,596	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025		179		186,442	0.2
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. VI	4.75%	02/01/2026		90		93,731	0.1
Eldorado Gold Corp.	9.50%	06/01/2024		257		272,155	0.2
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.75%	05/15/2022		427		433,680	0.4
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	5.13%	03/15/2023		6		6,227	0.0
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	5.13%	05/15/2024		182		189,468	0.2
Freeport-McMoRan, Inc.	5.00%	09/01/2027		126		127,986	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.25%	09/01/2029		126		129,546	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.45%	03/15/2043		311		308,105	0.3
Graphic Packaging International LLC	4.75%	04/15/2021		53		53,849	0.0
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027		42		43,986	0.0
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.	7.38%	12/15/2023		296		296,355	0.3
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	11.00%	05/15/2022		374		371,063	0.3
Kaiser Aluminum Corp.	6.50%	05/01/2025		69		70,736	0.1
Kraton Polymers LLC/Kraton Polymers Capital Corp.	5.25%	05/15/2026	EUR	100		109,005	0.1
Kraton Polymers LLC/Kraton Polymers Capital Corp.	7.00%	04/15/2025	USD	85		85,017	0.1
Magnetation LLC/Mag Finance Corp.(a) (b)	11.00%	05/15/2018		64		0	0.0
NOVA Chemicals Corp.	4.88%	06/01/2024		80		73,797	0.1
NOVA Chemicals Corp.	5.25%	06/01/2027		150		127,259	0.1
Novelis Corp.	5.88%	09/30/2026		169		173,241	0.1
OCI NV	5.25%	11/01/2024		200		195,933	0.2
OCI NV	6.63%	04/15/2023		200		207,381	0.2
Olin Corp.	5.00%	02/01/2030		121		104,806	0.1
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029		165		149,088	0.1
Olin Corp.	9.50%	06/01/2025		57		62,208	0.1
Peabody Energy Corp.	6.00%	03/31/2022		157		107,782	0.1
Peabody Energy Corp.	6.38%	03/31/2025		100		54,344	0.0
PolyOne Corp.	5.75%	05/15/2025		71		74,398	0.1
Reynolds Group Issuer, Inc./Reynolds Group Issuer LLC/ Reynolds Group Issuer Lu	5.13%	07/15/2023		274		276,875	0.2
Reynolds Group Issuer, Inc./Reynolds Group Issuer LLC/ Reynolds Group Issuer Lu	7.00%	07/15/2024		47		47,454	0.0
Sealed Air Corp.	6.88%	07/15/2033		107		126,347	0.1
SPCM SA	4.88%	09/15/2025		403		414,840	0.4
United States Steel Corp.	12.00%	06/01/2025		305		305,921	0.3
Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030		367		365,955	0.3
WR Grace & Co.-Conn	5.13%	10/01/2021		105		107,919	0.1
WR Grace & Co.-Conn	5.63%	10/01/2024		50		50,823	0.0
						6,708,974	5.7
INVESTITIONSGÜTER							
ARD Finance SA(c)	5.00%	06/30/2027	EUR	192		201,537	0.2
Bombardier, Inc.	5.75%	03/15/2022	USD	246		163,556	0.1
Bombardier, Inc.	6.00%	10/15/2022		246		160,366	0.1
Bombardier, Inc.	6.13%	01/15/2023		80		49,071	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024		452		277,032	0.2
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025		169		102,673	0.1
Clean Harbors, Inc.	4.88%	07/15/2027		72		74,529	0.1
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029		87		91,705	0.1
Colfax Corp.	6.00%	02/15/2024		36		37,705	0.0
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026		16		16,833	0.0
Cornerstone Building Brands, Inc.	8.00%	04/15/2026		113		108,439	0.1
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. IV	4.50%	01/15/2023		117		121,711	0.1
EnerSys	4.38%	12/15/2027		130		126,910	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026		401		390,975	0.3
GFL Environmental, Inc.	5.13%	12/15/2026		70		73,111	0.1
GFL Environmental, Inc.	7.00%	06/01/2026		123		130,034	0.1
GFL Environmental, Inc.	8.50%	05/01/2027		56		61,865	0.1
Granite US Holdings Corp.	11.00%	10/01/2027		79		75,036	0.1
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028		355		351,268	0.3
Harsco Corp.	5.75%	07/31/2027		83		81,431	0.1
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025		41		39,205	0.0
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	5.50%	04/15/2024		125		124,902	0.1
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	7.25%	04/15/2025		153		138,662	0.1

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	USD	142	$ 135,899	0.1%
Mueller Water Products, Inc.	5.50%	06/15/2026		108	111,765	0.1
RBS Global, Inc./Rexnord LLC.	4.88%	12/15/2025		118	118,007	0.1
Signature Aviation US Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2028		150	133,046	0.1
Signature Aviation US Holdings, Inc.	5.38%	05/01/2026		226	214,908	0.2
Silgan Holdings, Inc.	2.25%	06/01/2028	EUR	189	205,079	0.2
SPX FLOW, Inc.	5.88%	08/15/2026	USD	214	216,195	0.2
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026		28	28,959	0.0
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	6.13%	07/15/2023		67	67,280	0.1
Terex Corp.	5.63%	02/01/2025		277	257,647	0.2
Triumph Group, Inc.	5.25%	06/01/2022		41	33,405	0.0
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024		17	14,570	0.0
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025		256	170,380	0.1
Trivium Packaging Finance BV	8.50%	08/15/2027		400	421,261	0.4
					5,126,957	4.3
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Altice Financing SA	5.00%	01/15/2028		685	688,430	0.6
Altice Financing SA	7.50%	05/15/2026		200	210,469	0.2
AMC Networks, Inc.	5.00%	04/01/2024		193	195,153	0.2
Banijay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025		295	292,025	0.2
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.00%	03/01/2023		253	255,554	0.2
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	03/01/2030		65	67,951	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.00%	02/01/2028		504	527,821	0.4
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.13%	05/01/2027		76	79,710	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.75%	02/15/2026		1,262	1,314,105	1.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.88%	04/01/2024		262	270,449	0.2
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027		105	105,000	0.1
CSC Holdings LLC	5.50%	05/15/2026		522	545,339	0.5
CSC Holdings LLC	6.50%	02/01/2029		725	800,988	0.7
CSC Holdings LLC	10.88%	10/15/2025		336	363,862	0.3
Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co.	5.38%	08/15/2026		114	90,496	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	07/15/2022		77	79,121	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024		64	63,252	0.1
DISH DBS Corp.	6.75%	06/01/2021		435	443,865	0.4
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026		499	517,783	0.4
DISH Network Corp.	3.38%	08/15/2026		85	74,231	0.1
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028		105	100,916	0.1
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026		98	102,958	0.1
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027		79	73,593	0.1
Lamar Media Corp.	3.75%	02/15/2028		235	227,991	0.2
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029		27	27,723	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027		625	651,482	0.5
Liberty Interactive LLC	8.25%	02/01/2030		22	20,315	0.0
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026		532	492,624	0.4
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026		172	103,519	0.1
Netflix, Inc.	5.88%	11/15/2028		175	199,256	0.2
RR Donnelley & Sons Co.	7.88%	03/15/2021		17	16,928	0.0
Scripps Escrow, Inc.	5.88%	07/15/2027		124	115,307	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.13%	02/15/2027		176	164,666	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030		231	213,697	0.2
Sinclair Television Group, Inc.	5.63%	08/01/2024		110	109,204	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	08/01/2022		95	95,228	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	4.63%	05/15/2023		25	25,110	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	4.63%	07/15/2024		91	93,153	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.00%	08/01/2027		64	66,967	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.38%	07/15/2026		40	41,486	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029		543	583,522	0.5
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	EUR	100	103,954	0.1
TEGNA, Inc.	4.63%	03/15/2028	USD	157	149,115	0.1
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029		429	407,553	0.3
Univision Communications, Inc.	5.13%	05/15/2023		186	181,001	0.1
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025		112	106,987	0.1
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025		150	161,083	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	4.88%	01/15/2027	GBP	100	124,428	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	08/15/2026	USD	638	661,449	0.5
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027		270	285,360	0.2
					12,692,179	10.7
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026		1,006	1,066,899	0.9
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027		400	396,212	0.3
CenturyLink, Inc.	5.13%	12/15/2026		927	936,350	0.8
CenturyLink, Inc., Series S	6.45%	06/15/2021		313	323,214	0.3
CenturyLink, Inc., Series T	5.80%	03/15/2022		217	225,776	0.2
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2022		23	22,116	0.0
GTT Communications, Inc.	7.88%	12/31/2024		12	6,680	0.0

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	USD	53	$	55,311	0.0%
Intelsat Jackson Holdings SA(d)	5.50%	08/01/2023		697		376,039	0.3
Intelsat Jackson Holdings SA.	9.50%	09/30/2022		598		672,461	0.6
Level 3 Financing, Inc.	5.13%	05/01/2023		65		65,010	0.1
Level 3 Financing, Inc.	5.25%	03/15/2026		56		58,278	0.0
Level 3 Financing, Inc.	5.38%	01/15/2024		154		156,038	0.1
Nexstar Broadcasting, Inc.	5.63%	07/15/2027		88		90,187	0.1
Sprint Capital Corp.	8.75%	03/15/2032		144		207,498	0.2
Sprint Communications, Inc.	6.00%	11/15/2022		378		402,581	0.3
Sprint Corp.	7.13%	06/15/2024		720		816,775	0.7
Sprint Corp.	7.63%	02/15/2025		141		164,764	0.1
Sprint Corp.	7.88%	09/15/2023		161		182,478	0.2
T-Mobile USA, Inc.	4.50%	02/01/2026		492		505,466	0.4
T-Mobile USA, Inc.	4.75%	02/01/2028		6		6,373	0.0
T-Mobile USA, Inc.	6.50%	01/15/2026		113		119,362	0.1
Telecom Italia Capital SA	6.38%	11/15/2033		100		111,773	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036		218		249,601	0.2
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038		66		80,023	0.1
Zayo Group Holdings, Inc.	6.13%	03/01/2028		118		116,910	0.1
						7,414,175	6.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ							
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025		190		203,801	0.2
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029		147		150,194	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	04/01/2025		168		159,908	0.1
Dana Financing Luxembourg SARL	6.50%	06/01/2026		243		245,470	0.2
Dana, Inc.	5.50%	12/15/2024		30		30,012	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028		118		100,791	0.1
Exide Technologies, (First Lien)(a) (c) (d)	11.00%	10/31/2024		58		0	0.0
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023		449		465,974	0.4
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025		129		135,482	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	3.10%	05/04/2023		200		186,692	0.2
Ford Motor Credit Co. LLC	3.22%	01/09/2022		889		854,359	0.7
Ford Motor Credit Co. LLC	4.06%	11/01/2024		650		612,927	0.5
Garrett LX I SARL/Garrett Borrowing LLC	5.13%	10/15/2026	EUR	596		437,462	0.4
IHO Verwaltungs GmbH(c)	6.00%	05/15/2027	USD	200		192,463	0.2
Meritor, Inc.	6.25%	02/15/2024		40		40,192	0.0
Navistar International Corp.	6.63%	11/01/2025		232		218,020	0.2
Navistar International Corp.	9.50%	05/01/2025		95		102,859	0.1
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	6.25%	05/15/2026		162		165,996	0.2
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	8.50%	05/15/2027		405		396,900	0.3
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2024	EUR	345		298,436	0.3
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2026	USD	91		46,289	0.0
Titan International, Inc.	6.50%	11/30/2023		51		27,952	0.0
Truck Hero, Inc.	8.50%	04/21/2024		115		103,500	0.1
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025		284		276,946	0.2
						5,452,625	4.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG							
AMC Entertainment Holdings, Inc.	5.88%	11/15/2026		75		18,873	0.0
Cedar Fair LP	5.25%	07/15/2029		24		22,712	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op	5.38%	04/15/2027		115		109,585	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op	5.50%	05/01/2025		303		309,335	0.2
Constellation Merger Sub, Inc.	8.50%	09/15/2025		21		14,242	0.0
Mattel, Inc.	6.75%	12/31/2025		101		105,782	0.1
NCL Corp., Ltd.	3.63%	12/15/2024		418		251,354	0.2
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025		100		102,730	0.1
Six Flags Entertainment Corp.	4.88%	07/31/2024		121		113,959	0.1
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025		74		78,144	0.1
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025		58		61,095	0.1
Viking Cruises Ltd.	5.88%	09/15/2027		220		132,243	0.1
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028		111		90,951	0.1
						1,411,005	1.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE							
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025		173		159,108	0.1
Ashton Woods USA LLC/Ashton Woods Finance Co.	6.75%	08/01/2025		31		28,648	0.0
AZEK Co. LLC (The)	9.50%	05/15/2025		126		134,816	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	5.88%	10/15/2027		106		99,731	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025		97		97,670	0.1
Boyd Gaming Corp.	8.63%	06/01/2025		128		136,629	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US Corp.	4.88%	02/15/2030		60		50,703	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US Corp.	6.25%	09/15/2027		349		332,234	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Caesars Entertainment Corp.	5.00%	10/01/2024	USD 12	$ 19,159	0.0%
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025	393	385,291	0.3
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	4.25%	09/01/2024	85	85,113	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	4.88%	01/15/2030	27	26,836	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.13%	05/01/2026	15	15,118	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025	68	69,566	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.75%	05/01/2028	74	76,403	0.1
Hilton Grand Vacations Borrower LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower, Inc.	6.13%	12/01/2024	43	41,456	0.0
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	119	120,432	0.1
International Game Technology PLC	6.25%	02/15/2022	200	204,071	0.2
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	400	407,143	0.3
K. Hovnanian Enterprises, Inc.	10.00%	07/15/2022	49	24,055	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029	104	105,338	0.1
KB Home	7.50%	09/15/2022	28	30,586	0.0
KB Home	7.63%	05/15/2023	52	57,079	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	188	194,641	0.2
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC, Series WI	6.50%	09/15/2026	133	132,186	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	120	110,693	0.1
Mattamy Group Corp.	5.25%	12/15/2027	145	139,542	0.1
Meritage Homes Corp.	5.13%	06/06/2027	55	56,745	0.0
Meritage Homes Corp.	7.00%	04/01/2022	51	53,466	0.0
MGM Resorts International	5.50%	04/15/2027	197	191,652	0.2
MGM Resorts International	5.75%	06/15/2025	25	24,905	0.0
MGM Resorts International	6.00%	03/15/2023	139	139,627	0.1
MGM Resorts International	7.75%	03/15/2022	150	155,186	0.1
Scientific Games International, Inc.	5.00%	10/15/2025	208	194,439	0.2
Scientific Games International, Inc.	7.00%	05/15/2028	130	114,541	0.1
Scientific Games International, Inc.	7.25%	11/15/2029	10	8,804	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	493	457,566	0.4
Stars Group Holdings BV/Stars Group US Co-Borrower LLC	7.00%	07/15/2026	169	179,361	0.2
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	49	48,236	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	358	356,872	0.3
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.63%	03/01/2024	66	65,176	0.1
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	5.38%	04/15/2026	202	192,753	0.2
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	6	5,562	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025	602	584,116	0.5
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	96	92,290	0.1
				6,205,544	5.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	4.38%	01/15/2028	260	255,616	0.2
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	5.75%	04/15/2025	204	216,777	0.2
Golden Nugget, Inc.	6.75%	10/15/2024	69	55,702	0.0
Golden Nugget, Inc.	8.75%	10/01/2025	113	74,543	0.1
IRB Holding Corp.	6.75%	02/15/2026	192	179,903	0.2
IRB Holding Corp.	7.00%	06/15/2025	85	88,101	0.1
Yum! Brands, Inc.	7.75%	04/01/2025	154	170,433	0.1
				1,041,075	0.9
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Asbury Automotive Group, Inc.	4.50%	03/01/2028	35	33,381	0.0
Asbury Automotive Group, Inc.	4.75%	03/01/2030	23	22,079	0.0
Burlington Coat Factory Warehouse Corp.	6.25%	04/15/2025	63	65,383	0.1
FirstCash, Inc.	5.38%	06/01/2024	28	28,160	0.0
Group 1 Automotive, Inc.	5.00%	06/01/2022	222	218,782	0.2
L Brands, Inc.	5.25%	02/01/2028	49	41,401	0.0
L Brands, Inc.	5.63%	10/15/2023	200	192,890	0.2
L Brands, Inc.	6.75%	07/01/2036	129	107,278	0.1
L Brands, Inc.	6.88%	11/01/2035	337	278,797	0.2
L Brands, Inc.	7.50%	06/15/2029	44	38,865	0.0
Murphy Oil USA, Inc.	5.63%	05/01/2027	63	65,604	0.1
Penske Automotive Group, Inc.	5.50%	05/15/2026	196	193,775	0.2
Penske Automotive Group, Inc.	5.75%	10/01/2022	62	62,193	0.1
PetSmart, Inc.	7.13%	03/15/2023	644	624,433	0.5
Rite Aid Corp.	6.13%	04/01/2023	21	19,665	0.0
Rite Aid Corp.	7.50%	07/01/2025	209	208,147	0.2
Sonic Automotive, Inc.	6.13%	03/15/2027	93	92,048	0.1
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	326	285,318	0.2
Staples, Inc.	10.75%	04/15/2027	191	130,202	0.1
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024	29	27,561	0.0
William Carter Co. (The)	5.50%	05/15/2025	79	81,529	0.1
William Carter Co. (The)	5.63%	03/15/2027	125	128,063	0.1
				2,945,554	2.5

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER							
Air Medical Group Holdings, Inc.	6.38%	05/15/2023	USD	124	$	118,434	0.1%
Air Methods Corp.	8.00%	05/15/2025		14		8,962	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.63%	01/15/2027		306		311,153	0.3
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.88%	02/15/2030		211		218,665	0.2
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	5.75%	03/15/2025		211		217,551	0.2
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	6.63%	06/15/2024		118		122,122	0.1
Avantor, Inc.	9.00%	10/01/2025		122		131,766	0.1
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027		197		215,597	0.2
Bausch Health Americas, Inc.	9.25%	04/01/2026		150		166,839	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	5.50%	03/01/2023		3		3,007	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.13%	04/15/2025		281		285,936	0.2
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029		173		177,797	0.2
Bausch Health Cos., Inc.	7.25%	05/30/2029		34		36,670	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	9.00%	12/15/2025		604		661,768	0.6
Catalent Pharma Solutions, Inc.	4.88%	01/15/2026		52		53,346	0.0
Catalent Pharma Solutions, Inc.	5.00%	07/15/2027		55		56,645	0.0
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	EUR	160		174,855	0.1
Chobani LLC/Chobani Finance Corp., Inc.	7.50%	04/15/2025	USD	93		92,986	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.25%	03/31/2023		301		291,899	0.2
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.63%	02/15/2025		119		114,559	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	8.63%	01/15/2024		410		413,247	0.4
CHS/Community Health Systems, Inc.	9.88%	06/30/2023		105		84,978	0.1
DaVita, Inc.	5.00%	05/01/2025		17		17,438	0.0
DaVita, Inc.	5.13%	07/15/2024		189		192,801	0.2
Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc.	6.00%	07/15/2023		281		216,370	0.2
Envision Healthcare Corp.	8.75%	10/15/2026		321		141,241	0.1
Fresh Market, Inc. (The)	9.75%	05/01/2023		27		19,474	0.0
Hadrian Merger Sub, Inc.	8.50%	05/01/2026		181		151,799	0.1
HCA, Inc.	5.38%	09/01/2026		52		57,566	0.1
HCA, Inc.	5.63%	09/01/2028		55		63,015	0.1
Hill-Rom Holdings, Inc.	4.38%	09/15/2027		28		28,736	0.0
Immucor, Inc.	11.13%	02/15/2022		36		27,922	0.0
IQVIA, Inc.	3.25%	03/15/2025	EUR	160		179,820	0.2
IQVIA, Inc.	5.00%	10/15/2026	USD	200		211,472	0.2
Kronos Acquisition Holdings, Inc.	9.00%	08/15/2023		487		475,581	0.4
LifePoint Health, Inc.	4.38%	02/15/2027		58		56,282	0.0
LifePoint Health, Inc.	6.75%	04/15/2025		130		138,983	0.1
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC.	5.50%	04/15/2025		11		2,249	0.0
MEDNAX, Inc.	5.25%	12/01/2023		56		54,949	0.0
MEDNAX, Inc.	6.25%	01/15/2027		266		251,039	0.2
Newell Brands, Inc.	4.35%	04/01/2023		80		82,531	0.1
Newell Brands, Inc.	4.70%	04/01/2026		80		82,876	0.1
Par Pharmaceutical, Inc.	7.50%	04/01/2027		74		75,655	0.1
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030		473		468,530	0.4
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029		115		120,810	0.1
Post Holdings, Inc.	5.75%	03/01/2027		90		94,671	0.1
Radiology Partners, Inc.	9.25%	02/01/2028		122		117,790	0.1
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc.	9.75%	12/01/2026		476		515,274	0.4
Spectrum Brands, Inc.	5.75%	07/15/2025		31		31,879	0.0
Sunshine Mid BV	6.50%	05/15/2026	EUR	205		224,401	0.2
Tenet Healthcare Corp.	4.88%	01/01/2026	USD	229		235,198	0.2
Tenet Healthcare Corp.	5.13%	05/01/2025		30		30,477	0.0
Tenet Healthcare Corp.	5.13%	11/01/2027		161		167,354	0.1
Tenet Healthcare Corp.	6.25%	02/01/2027		122		126,285	0.1
Tenet Healthcare Corp.	7.00%	08/01/2025		6		6,053	0.0
Tenet Healthcare Corp.	7.50%	04/01/2025		169		183,709	0.2
Tenet Healthcare Corp.	8.13%	04/01/2022		352		369,715	0.3
US Renal Care, Inc.	10.63%	07/15/2027		228		238,765	0.2
Vizient, Inc.	6.25%	05/15/2027		68		71,714	0.1
						9,489,206	8.0
ENERGIE							
Antero Resources Corp.	5.13%	12/01/2022		242		173,183	0.2
Antero Resources Corp.	5.38%	11/01/2021		68		60,876	0.1
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026		384		290,367	0.2
Callon Petroleum, Co.	6.25%	04/15/2023		112		36,717	0.0
Callon Petroleum, Co.	8.25%	07/15/2025		38		11,385	0.0
Cheniere Energy Partners LP	4.50%	10/01/2029		107		104,514	0.1
Cheniere Energy Partners LP	5.63%	10/01/2026		103		104,973	0.1
CITGO Petroleum Corp.	6.25%	08/15/2022		131		129,035	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Denbury Resources, Inc.	7.75%	02/15/2024	USD 75	$ 30,933	0.0%
Denbury Resources, Inc.	9.25%	03/31/2022	67	28,330	0.0
Diamond Offshore Drilling, Inc.(d)	4.88%	11/01/2043	374	41,952	0.0
Diamond Offshore Drilling, Inc.(d)	7.88%	08/15/2025	64	7,038	0.0
EnLink Midstream Partners LP	4.15%	06/01/2025	117	94,168	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024	31	25,403	0.0
EnLink Midstream Partners LP	4.85%	07/15/2026	330	265,304	0.2
EP Energy LLC/Everest Acquisition Finance, Inc.(d)	8.00%	11/29/2024	24	282	0.0
EP Energy LLC/Everest Acquisition Finance, Inc.(d)	9.38%	05/01/2024	141	1,680	0.0
EQM Midstream Partners LP	5.50%	07/15/2028	76	70,301	0.1
EQT Corp.	3.00%	10/01/2022	183	177,525	0.2
EQT Corp.	6.13%	02/01/2025	231	235,465	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024	80	73,222	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.00%	05/15/2023	262	246,926	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025	11	10,025	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	177	165,337	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	96	83,510	0.1
Gulfport Energy Corp.	6.00%	10/15/2024	264	154,116	0.1
Gulfport Energy Corp.	6.38%	05/15/2025	255	129,272	0.1
Hess Midstream Operations LP	5.63%	02/15/2026	286	277,320	0.2
HighPoint Operating Corp.	7.00%	10/15/2022	64	18,043	0.0
Hilcorp Energy I LP / Hilcorp Finance Co.	6.25%	11/01/2028	150	129,331	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	10/01/2025	125	110,759	0.1
Indigo Natural Resources LLC	6.88%	02/15/2026	237	229,304	0.2
Moss Creek Resources Holdings, Inc.	10.50%	05/15/2027	139	79,454	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	94	53,564	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028	95	52,249	0.0
Nabors Industries, Inc.	5.75%	02/01/2025	180	55,800	0.1
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023	407	316,607	0.3
Noble Holding International Ltd.	6.20%	08/01/2040	39	825	0.0
Noble Holding International Ltd.	7.75%	01/15/2024	20	478	0.0
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	08/15/2022	584	536,942	0.5
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023	186	160,076	0.1
Occidental Petroleum Corp.	2.90%	08/15/2024	116	91,803	0.1
Occidental Petroleum Corp.	3.40%	04/15/2026	30	22,185	0.0
Occidental Petroleum Corp.	3.50%	06/15/2025	129	100,640	0.1
Occidental Petroleum Corp.	5.55%	03/15/2026	865	735,279	0.6
Occidental Petroleum Corp.	6.20%	03/15/2040	110	75,161	0.1
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	175	161,635	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	85	80,863	0.1
QEP Resources, Inc.	5.25%	05/01/2023	117	62,400	0.1
QEP Resources, Inc.	5.38%	10/01/2022	63	35,856	0.0
Range Resources Corp.	5.00%	08/15/2022	46	43,058	0.0
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023	86	77,726	0.1
Range Resources Corp.	5.88%	07/01/2022	5	4,729	0.0
SandRidge Energy, Inc.(a)	7.50%	02/15/2023	20	0	0.0
SandRidge Energy, Inc.(a)	8.13%	10/15/2022	185	0	0.0
SM Energy Co.	5.00%	01/15/2024	6	3,170	0.0
SM Energy Co.	5.63%	06/01/2025	37	19,184	0.0
SM Energy Co.	6.13%	11/15/2022	39	23,783	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.50%	02/15/2026	227	230,405	0.2
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028	87	88,107	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	6.00%	04/15/2027	158	162,056	0.1
Targa Resources Partners LP/ Targa Resources Partners Finance Corp.	5.50%	03/01/2030	124	124,307	0.1
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	28	25,193	0.0
Transocean, Inc.	6.80%	03/15/2038	329	98,382	0.1
Transocean, Inc.	8.00%	02/01/2027	417	228,085	0.2
Vantage Drilling International(a)	7.50%	11/01/2019	117	0	0.0
Vine Oil & Gas LP/Vine Oil & Gas Finance Corp.	8.75%	04/15/2023	186	123,656	0.1
Weatherford International Ltd.	11.00%	12/01/2024	14	9,460	0.0
Western Midstream Operating LP	3.10%	02/01/2025	232	215,706	0.2
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	109	101,360	0.1
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022	101	99,192	0.1
Western Midstream Operating LP	4.05%	02/01/2030	151	135,486	0.1
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	301	273,847	0.2
Western Midstream Operating LP	4.65%	07/01/2026	165	153,659	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	34	31,019	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	76	62,048	0.1
Whiting Petroleum Corp.(d)	6.63%	01/15/2026	129	14,717	0.0
				8,486,748	7.2
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	5.88%	05/15/2026	115	119,001	0.1
H&E Equipment Services, Inc.	5.63%	09/01/2025	30	29,367	0.0
IAA, Inc.	5.50%	06/15/2027	116	118,389	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025	USD	229	$ 217,048	0.2%
Laureate Education, Inc.	8.25%	05/01/2025		49	51,766	0.0
					535,571	0.4
DIENSTLEISTUNGEN						
ACE Cash Express, Inc.	12.00%	12/15/2022		19	14,265	0.0
ADT Security Corp. (The)	4.88%	07/15/2032		255	242,704	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026		197	208,112	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027		275	292,187	0.2
Aptim Corp.	7.75%	06/15/2025		239	83,650	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027		58	54,629	0.0
APX Group, Inc.	7.88%	12/01/2022		352	367,840	0.3
Aramark Services, Inc.	5.00%	04/01/2025		143	143,774	0.1
Aramark Services, Inc.	5.00%	02/01/2028		259	255,247	0.2
Carriage Services, Inc.	6.63%	06/01/2026		18	18,742	0.0
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023	EUR	284	257,919	0.2
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	USD	60	60,451	0.1
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027		207	215,177	0.2
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027		145	132,675	0.1
Monitronics International, Inc.(a)	9.13%	04/01/2020		68	0	0.0
Nielsen Co. Luxembourg SARL (The)	5.00%	02/01/2025		368	370,806	0.3
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024		137	142,781	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026		70	72,797	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028		358	340,129	0.3
Refinitiv US Holdings, Inc.	8.25%	11/15/2026		30	32,952	0.0
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025		46	47,376	0.0
Sabre GLBL, Inc.	5.25%	11/15/2023		61	57,928	0.1
Sabre GLBL, Inc.	5.38%	04/15/2023		152	143,619	0.1
Sabre GLBL, Inc.	9.25%	04/15/2025		90	96,565	0.1
Verscend Escrow Corp.	9.75%	08/15/2026		285	306,405	0.3
					3,958,730	3.3
TECHNOLOGIE						
Ascend Learning LLC	6.88%	08/01/2025		28	27,870	0.0
Banff Merger Sub, Inc.	9.75%	09/01/2026		220	220,699	0.2
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025		96	101,407	0.1
CDK Global, Inc.	5.88%	06/15/2026		162	171,059	0.2
CDW LLC/CDW Finance Corp.	4.13%	05/01/2025		92	94,419	0.1
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024		83	85,246	0.1
CommScope, Inc.	5.50%	06/15/2024		53	52,078	0.1
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026		121	127,435	0.1
CommScope, Inc.	8.25%	03/01/2027		238	248,199	0.2
Dell International LLC/EMC Corp.	5.88%	06/15/2021		52	52,031	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	7.13%	06/15/2024		293	304,367	0.3
EIG Investors Corp.	10.88%	02/01/2024		19	17,602	0.0
Genesys Telecommunications Laboratories, Inc./ Greeneden Lux 3 SARL/Greeneden US Ho	10.00%	11/30/2024		18	19,204	0.0
Microchip Technology, Inc.	4.25%	09/01/2025		110	110,652	0.1
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027		89	88,860	0.1
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029		133	132,510	0.1
NCR Corp.	8.13%	04/15/2025		97	104,287	0.1
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027		15	14,822	0.0
Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028		13	12,858	0.0
Rackspace Hosting, Inc.	8.63%	11/15/2024		211	220,103	0.2
Riverbed Technology, Inc.	8.88%	03/01/2023		14	8,366	0.0
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028		42	42,940	0.0
Solera LLC/Solera Finance, Inc.	10.50%	03/01/2024		491	499,257	0.4
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	02/01/2023		400	390,456	0.3
					3,146,727	2.7
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Algeco Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023		200	186,268	0.2
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027		68	52,115	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	10.50%	05/15/2025		92	102,367	0.1
Europcar Mobility Group	4.00%	04/30/2026	EUR	100	66,533	0.1
Herc Holdings, Inc.	5.50%	07/15/2027	USD	48	46,756	0.0
Hertz Corp. (The)(d)	5.50%	10/15/2024		293	49,321	0.0
Hertz Corp. (The)(d)	6.00%	01/15/2028		114	19,354	0.0
Hertz Corp. (The)(d)	6.25%	10/15/2022		30	5,070	0.0
Hertz Corp. (The)(d)	7.13%	08/01/2026		9	1,521	0.0
United Rentals North America, Inc.	5.50%	07/15/2025		37	38,288	0.0
United Rentals North America, Inc.	5.88%	09/15/2026		145	152,523	0.1
United Rentals North America, Inc.	6.50%	12/15/2026		176	188,205	0.2
XPO Logistics, Inc.	6.13%	09/01/2023		106	107,646	0.1
XPO Logistics, Inc.	6.75%	08/15/2024		163	171,002	0.2
					1,186,969	1.0
					75,802,039	63.9

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
FINANZINSTITUTE								
BANKWESEN								
	Alliance Data Systems Corp.	4.75%	12/15/2024	USD	316	$	282,775	0.2%
	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(e)	5.88%	05/24/2022	EUR	200		214,796	0.2
	Banco Santander SA(e)	5.25%	09/29/2023		400		419,596	0.4
	Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	USD	200		200,223	0.2
	Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026		200		205,228	0.2
	Royal Bank of Scotland Group PLC, Series U(e) (f)	3.77%	09/30/2027		200		180,836	0.1
							1,503,454	1.3
MAKLER								
	LPL Holdings, Inc.	5.75%	09/15/2025		173		180,492	0.1
	NFP Corp.	6.88%	07/15/2025		250		241,063	0.2
	NFP Corp.	7.00%	05/15/2025		60		62,172	0.1
							483,727	0.4
FINANZEN								
	CNG Holdings, Inc.	12.50%	06/15/2024		108		94,600	0.1
	Compass Group Diversified Holdings LLC	8.00%	05/01/2026		19		20,171	0.0
	Curo Group Holdings Corp.	8.25%	09/01/2025		161		127,954	0.1
	goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024		257		241,947	0.2
	Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR	100		100,906	0.1
	Navient Corp.	5.50%	01/25/2023	USD	453		431,554	0.4
	Navient Corp.	6.50%	06/15/2022		43		42,250	0.0
	Navient Corp.	6.75%	06/15/2026		90		82,897	0.1
	SLM Corp.	5.13%	04/05/2022		54		53,211	0.0
	Springleaf Finance Corp.	6.88%	03/15/2025		167		164,739	0.1
	Springleaf Finance Corp.	7.13%	03/15/2026		130		128,573	0.1
	Springleaf Finance Corp.	8.88%	06/01/2025		195		202,712	0.2
	TMX Finance LLC/TitleMax Finance Corp.	11.13%	04/01/2023		143		114,241	0.1
							1,805,755	1.5
VERSICHERUNGEN								
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	7.00%	11/15/2025		298		283,055	0.2
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	8.13%	02/15/2024		135		143,668	0.1
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	10.13%	08/01/2026		46		48,038	0.1
	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer	6.75%	10/15/2027		230		235,444	0.2
	AssuredPartners, Inc.	7.00%	08/15/2025		27		26,328	0.0
	Genworth Holdings, Inc.	7.20%	02/15/2021		120		110,545	0.1
	Genworth Holdings, Inc.	7.63%	09/24/2021		95		87,543	0.1
	HUB International Ltd.	7.00%	05/01/2026		97		99,564	0.1
	Polaris Intermediate Corp.(c)	8.50%	12/01/2022		653		572,556	0.5
	USI, Inc./NY	6.88%	05/01/2025		13		13,311	0.0
							1,620,052	1.4
SONSTIGE FINANZWERTE								
	Intrum AB	2.75%	07/15/2022	EUR	56		57,295	0.0
	Intrum AB	3.50%	07/15/2026		241		228,986	0.2
							286,281	0.2
REITS								
	Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	USD	457		347,280	0.3
	Diversified Healthcare Trust	4.75%	02/15/2028		114		94,772	0.1
	Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025		197		200,369	0.2
	GEO Group, Inc. (The)	6.00%	04/15/2026		30		23,490	0.0
	Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028		15		15,273	0.0
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.63%	05/01/2024		256		267,440	0.2
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.75%	02/01/2027		138		144,758	0.1
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	4.88%	06/01/2023		105		93,407	0.1
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	9.38%	04/01/2027		349		303,289	0.3
	Service Properties Trust	4.35%	10/01/2024		60		52,800	0.0
	Service Properties Trust	4.50%	03/15/2025		85		73,464	0.1
							1,616,342	1.4
							7,315,611	6.2
VERSORGUNGSBETRIEBE								
ELEKTRIZITÄT								
	Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028		536		543,978	0.4
	Calpine Corp.	5.25%	06/01/2026		314		325,614	0.3
	Calpine Corp.	5.50%	02/01/2024		71		71,667	0.1
	Calpine Corp.	5.75%	01/15/2025		202		206,659	0.2
	NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027		36		38,443	0.0
	NRG Energy, Inc.	7.25%	05/15/2026		116		124,414	0.1
	Talen Energy Supply LLC	6.50%	06/01/2025		158		106,977	0.1
	Talen Energy Supply LLC	7.25%	05/15/2027		204		208,456	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Talen Energy Supply LLC	10.50%	01/15/2026	USD 52	$ 39,842	0.0%
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	272	288,681	0.2
				1,954,731	1.6
				85,072,381	71.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ArcelorMittal SA	7.25%	10/15/2039	107	127,442	0.1
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	44	45,629	0.1
Methanex Corp.	5.25%	12/15/2029	180	156,526	0.1
				329,597	0.3
INVESTITIONSGÜTER					
Arconic, Inc.	5.90%	02/01/2027	6	6,061	0.0
General Electric Co.	6.75%	03/15/2032	180	216,106	0.2
General Electric Co., Series D(e)	5.00%	01/21/2021	54	41,445	0.0
				263,612	0.2
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Hughes Satellite Systems Corp.	5.25%	08/01/2026	128	132,511	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Co.	4.88%	10/02/2023	103	106,483	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	3.25%	01/05/2023	45	44,746	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	3.70%	05/09/2023	55	54,882	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.00%	10/06/2026	7	6,973	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.25%	05/15/2023	59	59,784	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	4.30%	07/13/2025	48	48,615	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.10%	01/17/2024	72	74,830	0.1
General Motors Financial Co., Inc.	5.25%	03/01/2026	24	25,149	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029	167	181,055	0.2
Lear Corp.	4.25%	05/15/2029	180	176,496	0.2
				779,013	0.7
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023	437	464,567	0.4
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	175	182,438	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	350	369,250	0.3
Silversea Cruise Finance Ltd.	7.25%	02/01/2025	35	33,183	0.0
				1,049,438	0.9
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Lennar Corp.	4.50%	04/30/2024	67	70,233	0.1
Lennar Corp.	4.75%	11/29/2027	132	143,867	0.1
Lennar Corp.	8.38%	01/15/2021	241	248,850	0.2
Marriott International, Inc./MD	5.75%	05/01/2025	48	51,989	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	288	302,396	0.3
PulteGroup, Inc.	5.00%	01/15/2027	161	172,414	0.1
PulteGroup, Inc.	5.50%	03/01/2026	6	6,629	0.0
PulteGroup, Inc.	6.00%	02/15/2035	133	149,891	0.1
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	266	300,340	0.3
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	44	53,558	0.0
Standard Industries, Inc./NJ	4.75%	01/15/2028	392	395,872	0.3
Standard Industries, Inc./NJ	5.38%	11/15/2024	56	57,133	0.1
Standard Industries, Inc./NJ	6.00%	10/15/2025	188	195,268	0.2
Toll Brothers Finance Corp.	4.35%	02/15/2028	200	203,758	0.2
Toll Brothers Finance Corp.	4.88%	03/15/2027	112	117,765	0.1
				2,469,963	2.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
McDonald's Corp.	3.30%	07/01/2025	52	57,486	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Sysco Corp.	5.65%	04/01/2025	38	43,390	0.1
Sysco Corp.	5.95%	04/01/2030	23	27,618	0.0
				71,008	0.1
ENERGIE					
Apache Corp.	4.25%	01/15/2030	81	71,937	0.1
Apache Corp.	4.38%	10/15/2028	433	383,281	0.3
Apache Corp.	5.35%	07/01/2049	126	96,866	0.1
Boardwalk Pipelines LP	4.45%	07/15/2027	45	43,075	0.0
Cenovus Energy, Inc.	5.40%	06/15/2047	197	153,349	0.1
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	6	5,378	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045	12	12,525	0.0
Enable Midstream Partners LP	3.90%	05/15/2024	366	340,300	0.3

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
	Energy Transfer Operating LP	4.50%	04/15/2024	USD	181	$	190,863	0.2%
	Hess Corp.	7.13%	03/15/2033		18		19,530	0.0
	Marathon Petroleum Corp.	4.50%	05/01/2023		114		121,557	0.1
	Marathon Petroleum Corp.	4.70%	05/01/2025		103		113,878	0.1
	National Oilwell Varco, Inc.	3.60%	12/01/2029		283		264,542	0.2
	ONEOK, Inc.	2.20%	09/15/2025		214		203,695	0.2
	ONEOK, Inc.	4.55%	07/15/2028		32		31,989	0.0
	ONEOK, Inc.	5.85%	01/15/2026		108		119,171	0.1
	Parsley Energy LLC/Parsley Finance Corp.	5.63%	10/15/2027		181		177,380	0.1
	PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	9.25%	05/15/2025		279		302,065	0.3
	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.60%	11/01/2024		131		131,113	0.1
	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026		75		76,234	0.1
	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.65%	10/15/2025		140		143,049	0.1
	Sunoco Logistics Partners Operations LP	3.90%	07/15/2026		9		9,006	0.0
	WPX Energy, Inc.	4.50%	01/15/2030		495		453,966	0.4
							3,464,749	2.9
DIENSTLEISTUNGEN								
	Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025		76		81,188	0.1
	Expedia Group, Inc.	7.00%	05/01/2025		154		164,684	0.1
							245,872	0.2
TECHNOLOGIE								
	Broadcom, Inc.	4.15%	11/15/2030		226		236,721	0.2
	Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025		105		117,413	0.1
	Ingram Micro, Inc.	5.45%	12/15/2024		43		41,282	0.0
	Nokia Oyj	3.38%	06/12/2022		64		65,121	0.1
	Nokia Oyj	6.63%	05/15/2039		108		118,870	0.1
	Seagate HDD Cayman	4.88%	03/01/2024		37		39,121	0.0
	Western Digital Corp.	4.75%	02/15/2026		517		544,727	0.5
							1,163,255	1.0
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN								
	Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025		405		419,163	0.4
	Southwest Airlines Co.	4.75%	05/04/2023		121		122,772	0.1
	Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025		125		127,009	0.1
							668,944	0.6
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN								
	Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022		138		115,867	0.1
	Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027		33		22,780	0.0
	Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023		73		58,158	0.0
	Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024		83		66,567	0.1
	Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025		9		6,496	0.0
							269,868	0.2
							10,965,316	9.3
FINANZINSTITUTE								
BANKWESEN								
	Ally Financial, Inc.	5.80%	05/01/2025		30		32,924	0.0
	Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031		146		178,689	0.1
	Bank of America Corp., Series DD(e)	6.30%	03/10/2026		90		99,019	0.1
	Bank of America Corp., Series X(e)	6.25%	09/05/2024		43		44,926	0.0
	Bank of America Corp., Series Z(e)	6.50%	10/23/2024		30		32,068	0.0
	BNP Paribas SA(e)	7.38%	08/19/2025		347		380,943	0.3
	CIT Group, Inc.	4.75%	02/16/2024		81		81,173	0.1
	Citigroup, Inc., Series T(e)	6.25%	08/15/2026		59		62,306	0.1
	Citigroup, Inc., Series U(e)	5.00%	09/12/2024		110		102,999	0.1
	Citigroup, Inc., Series V(e)	4.70%	01/30/2025		117		102,135	0.1
	Cooperatieve Rabobank UA(e)	3.25%	12/29/2026	EUR	200		206,448	0.2
	Danske Bank A/S, Series E(e)	5.88%	04/06/2022		200		224,739	0.2
	Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(e)	5.00%	11/10/2022	USD	101		93,030	0.1
	HSBC Holdings PLC(e)	6.38%	03/30/2025		350		354,794	0.3
	ING Groep NV(e)	6.50%	04/16/2025		300		303,730	0.3
	JPMorgan Chase & Co., Series FF(e)	5.00%	08/01/2024		274		257,527	0.2
	JPMorgan Chase & Co., Series HH(e)	4.60%	02/01/2025		136		120,003	0.1
	Nordea Bank Abp(e)	6.63%	03/26/2026		200		212,842	0.2
	Standard Chartered PLC(e) (f)	2.27%	01/30/2027		200		158,079	0.1
	UniCredit SpA(e)	7.50%	06/03/2026	EUR	200		228,807	0.2
	Wells Fargo & Co., Series S(e)	5.90%	06/15/2024	USD	250		249,983	0.2
							3,527,164	3.0
MAKLER								
	Charles Schwab Corp. (The), Series G(e)	5.38%	06/01/2025		163		171,089	0.1
FINANZEN								
	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.65%	07/21/2027		158		130,587	0.1
	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028		369		307,667	0.3
	Air Lease Corp.	2.25%	01/15/2023		138		128,710	0.1

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettovermögen %
	Air Lease Corp.	3.00%	02/01/2030	USD	9	$ 7,443	0.0%
	Air Lease Corp.	3.63%	04/01/2027		87	77,364	0.1
	Air Lease Corp.	3.63%	12/01/2027		37	32,667	0.0
	Air Lease Corp.	3.88%	07/03/2023		12	11,255	0.0
	Air Lease Corp.	4.25%	02/01/2024		50	47,237	0.0
	Air Lease Corp., Series G	3.75%	06/01/2026		11	10,005	0.0
						752,935	0.6
VERSICHERUNGEN							
	ACE Capital Trust II	9.70%	04/01/2030		90	128,796	0.1
	Centene Corp.	4.25%	12/15/2027		192	200,711	0.2
	Centene Corp.	4.63%	12/15/2029		6	6,460	0.0
	Centene Corp.	4.75%	01/15/2025		73	75,134	0.1
	Centene Corp.	5.38%	08/15/2026		226	239,848	0.2
	Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037		87	99,786	0.1
	Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044		15	15,135	0.0
	Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043		36	37,332	0.0
						803,202	0.7
REITS							
	GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	4.00%	01/15/2030		20	17,512	0.0
	GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.75%	06/01/2028		41	41,202	0.0
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027		196	202,502	0.2
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.25%	08/01/2026		75	77,679	0.1
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.50%	05/01/2024		34	34,428	0.0
	Sabra Health Care LP.	5.13%	08/15/2026		84	81,528	0.1
						454,851	0.4
						5,709,241	4.8
VERSORGUNGSBETRIEBE							
ELEKTRIZITÄT							
	Enel Americas SA	4.00%	10/25/2026		158	166,542	0.1
	Enel Chile SA.	4.88%	06/12/2028		173	192,290	0.2
						358,832	0.3
						17,033,389	14.4
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN							
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS							
	AB FCP I - Mortgage Income Portfolio - Class SA				12,344	910,849	0.8
	AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT				17,780	1,803,026	1.5
						2,713,875	2.3
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE							
MEXIKO							
	Mexican Bonos, Series M	5.75%	03/05/2026	MXN	2,804	127,242	0.1
	Mexican Bonos, Series M 20	10.00%	12/05/2024		1,800	96,039	0.0
						223,281	0.1
RUSSLAND							
	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6217.	7.50%	08/18/2021	RUB	4,866	71,436	0.1
VEREINIGTE STAATEN							
	U.S. Treasury Notes(g)	1.50%	09/30/2024	USD	2,242	2,360,406	2.0
						2,655,123	2.2
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN							
INDUSTRIE							
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION							
	Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027		213	215,182	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE							
	Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029		245	239,028	0.2
	Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024		200	197,812	0.1
						436,840	0.3
ENERGIE							
	Petrobras Global Finance BV	5.09%	01/15/2030		72	68,873	0.1
						720,895	0.6
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE							
BRASILIEN							
	Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F	10.00%	01/01/2021		669	130,746	0.1
SÜDAFRIKA							
	Republic of South Africa Government Bond Series 2023	7.75%	02/28/2023		851	51,503	0.1
						182,249	0.2
BANKDARLEHEN							
FINANZINSTITUTE							
	Jefferies Finance LLC (f)	3.19%	06/03/2026		21	19,031	0.0

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
INDUSTRIE							
	Triton Solar US Acquisition Co. (f)	7.07%	10/29/2024	USD	123	$ 103,277	0.1%
	U.S. Renal Care, Inc. (f)	5.19%	06/26/2026		41	39,389	0.0
						142,666	0.1
						161,697	0.1
STAMMAKTIEN							
	Avaya Holdings Corp.				2,121	30,967	0.0
	Constellium SE				4,479	36,772	0.0
	DISH Network Corp. - Class A				210	6,646	0.0
	Exide Technologies (a)				480	0	0.0
	Horizon Therapeutics PLC				457	23,184	0.0
	Tervita Corp.				22,520	61,336	0.1
						158,905	0.1
ABS-ANLEIHEN							
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS							
	Taco Bell Funding LLC, Series 2016-1A, Class A23	4.97%	05/25/2046	USD	59	61,740	0.0
	Wendy's Funding LLC, Series 2018-1A, Class A2I	3.57%	03/15/2048		81	79,072	0.1
						140,812	0.1
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN							
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH							
	Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2013-DN1, Class M2(f)	7.32%	07/25/2023		46	39,786	0.1
	Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities, Series 2015-C03, Class 2M2(f)	5.17%	07/25/2025		8	8,564	0.0
						48,350	0.1
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH							
	CSMC Mortgage-Backed Trust, Series 2006-7, Class 3A12	6.25%	08/25/2036		5	3,241	0.0
	Residential Accredit Loans, Inc. Trust, Series 2005-QA10, Class A31	4.53%	09/25/2035		29	23,898	0.0
						27,139	0.0
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH							
	RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-B, Class 1A4(f)	0.62%	01/25/2037		34	12,282	0.0
						87,771	0.1
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE							
QUASI-STAATSANLEIHEN							
VEREINIGTE STAATEN							
	Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024		26	25,237	0.0
VORZUGSAKTIEN							
VERSORGUNGSBETRIEBE							
ELEKTRIZITÄT							
	SCE Trust III, Series H	5.75%			375	8,681	0.0
INDUSTRIE							
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE							
	Hovnanian Enterprises, Inc	7.63%			365	1,563	0.0
						10,244	0.0
OPTIONSSCHEINE							
	Avaya Holdings Corp.,expiring 12/15/2022				5,308	7,962	0.0
	Battalion Oil Corp.,expiring 10/08/2022				29	0	0.0
	Halcon Resources Corp.,expiring 10/08/2022				10	0	0.0
						7,962	0.0
						108,970,540	91.8
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE							
ABS-ANLEIHEN							
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS							
	DB Master Finance LLC, Series 2017-1A, Class A2I	3.63%	11/20/2047	USD	175	176,138	0.2
BANKDARLEHEN							
INDUSTRIE							
	California Resources Corporation (f)	11.38%	12/31/2021		14	644	0.0
STAMMAKTIEN							
	ATD New Holdings, Inc. (a)				1,800	26,325	0.1
	Battalion Oil Corp.				2	12	0.0
	BIS Industries Holdings Ltd. (a)				59,990	0	0.0
	CHC Group LLC (a)				5,858	2,343	0.0
	Exide Corp. (a)				48,730	0	0.0
	iHeartMedia, Inc. - Class A				271	2,358	0.0
	K201640219 (South Africa) Ltd. A Shares (a)				821,795	1	0.0
	K201640219 (South Africa) Ltd. B Shares (a)				129,877	0	0.0
	Monitronics International, Inc.				1,531	4,593	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
Monitronics International, Inc. (a)			1,269	$	3,662	0.0%
Paragon Offshore Ltd. - Class A (a)			455		45	0.0
Paragon Offshore Ltd. - Class B (a)			682		4,092	0.0
Southeastern Grocers, Inc. Npv (a)			3,452		110,464	0.1
Vantage Drilling International			599		3,444	0.0
Willscot Corp. (a)			1,599		21,331	0.0
					178,670	0.2
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Glencore Finance Canada Ltd.	6.00%	11/15/2041	USD 14		15,473	0.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
MAKLER						
NFP Corp.	8.00%	07/15/2025	55		52,658	0.1
FINANZEN						
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	330		282,971	0.2
					335,629	0.3
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
OCI NV	5.00%	04/15/2023	EUR 100		112,634	0.1
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
CSC Holdings LLC	5.38%	07/15/2023	USD 200		202,769	0.2
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	8		6,391	0.0
					209,160	0.2
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Intrado Corp.	8.50%	10/15/2025	35		25,236	0.0
Sprint Corp.	7.63%	03/01/2026	262		313,068	0.3
					338,304	0.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Exide Technologies, (Exchange Priority)(a) (c) (d)	11.00%	10/31/2024	172		17,195	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Boyd Gaming Corp.	4.75%	12/01/2027	47		43,265	0.0
Eldorado Resorts, Inc.	6.00%	04/01/2025	55		56,282	0.1
Forestar Group, Inc.	5.00%	03/01/2028	171		160,981	0.1
Forestar Group, Inc.	8.00%	04/15/2024	112		113,000	0.1
Twin River Worldwide Holdings, Inc.	6.75%	06/01/2027	32		29,467	0.0
Wyndham Destinations, Inc.	4.63%	03/01/2030	341		294,689	0.3
					697,684	0.6
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Newell Brands, Inc.	6.00%	04/01/2046	123		127,505	0.1
ENERGIE						
CHC Group LLC/CHC Finance Ltd., Series AI	0.00%	10/01/2020	312		46,800	0.0
Comstock Resources Inc.	7.50%	05/15/2025	323		284,979	0.2
EP Energy LLC/Everest Acquisition Finance, Inc.(d)	7.75%	09/01/2022	174		93	0.0
Parkland Corp./Canada	6.00%	04/01/2026	195		196,965	0.2
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp.	6.50%	07/15/2027	145		151,683	0.1
					680,520	0.5
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
Univar Solutions USA, Inc./Washington	5.13%	12/01/2027	27		27,372	0.0
DIENSTLEISTUNGEN						
Carlson Travel, Inc.	6.75%	12/15/2023	200		130,711	0.1
Refinitiv US Holdings, Inc.	6.25%	05/15/2026	87		92,983	0.1
					223,694	0.2
TECHNOLOGIE						
Exela Intermediate LLC/Exela Finance, Inc.	10.00%	07/15/2023	28		4,809	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Algeco Global Finance PLC	6.50%	02/15/2023	EUR 100		104,884	0.1
					2,543,761	2.1
					2,879,390	2.4
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	05/15/2022	USD 200		189,625	0.2
K2016470219 South Africa Ltd.(c)	3.00%	12/31/2022	66		175	0.0
K2016470260 South Africa Ltd.(c)	25.00%	12/31/2022	28		24	0.0

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettovermögen %
	Tonon Luxembourg SA(a) (c)	6.50%	10/31/2024	USD	76	$ 2,286	0.0%
						192,110	0.2
VERSORGUNGSBETRIEBE							
	Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026		104	102,273	0.1
						294,383	0.3
OPTIONSSCHEINE							
	iHeart Media, Inc., expiring 05/01/2039				2,036	15,270	0.0
	SandRidge Energy, Inc., A-CW22, expiring 10/04/2022(a)				7,878	1,418	0.0
	SandRidge Energy, Inc., B-CW22, expiring 10/04/2022(a)				3,316	33	0.0
	Willscot Corp., expiring 11/29/2022(a)				2,476	6,505	0.0
						23,226	0.0
						3,567,924	3.1
Gesamtanlagen							
	(Kosten $118,886,352)					$ 112,538,464	94.9%
Termineinlagen							
	BBH, Grand Cayman(h)	(0.67)%	–			3,261	0.0
	BBH, Grand Cayman(h)	(0.26)%	–			15	0.0
	BBH, Grand Cayman(h)	0.01 %	–			9,163	0.0
	JPMorgan Chase, New York(h)	0.01 %	–			2,804,929	2.4
Termineinlagen insgesamt						2,817,368	2.4
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten						3,220,626	2.7
Nettovermögen						$ 118,576,458	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
E-Mini Russell 2000 Index Futures	06/19/2020	1	$ 62,924	$ 69,640	$ 6,716
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	155	19,447,648	19,471,875	24,227
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2020	16	2,221,703	2,225,000	3,297
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2020	13	2,035,117	2,045,266	(10,149)
					$ 24,091
				Wertsteigerung	$ 34,240
				Wertminderung	$ (10,149)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
BNP Paribas SA	USD	187	BRL	1,005	06/02/2020	$ 1,447
BNP Paribas SA	BRL	1,005	USD	187	07/02/2020	(1,439)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	1,227	USD	1,343	06/10/2020	(18,945)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	681	EUR	628	06/10/2020	16,473
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	4,145	USD	168	06/19/2020	(18,223)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	66	USD	81	07/17/2020	(494)
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	727	USD	39	07/17/2020	(1,905)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	220	USD	158	08/06/2020	(1,225)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5,592	EUR	5,158	06/12/2020	133,774
Morgan Stanley & Co., Inc.	RUB	9,408	USD	126	07/14/2020	(6,703)
Morgan Stanley & Co., Inc.	IDR	597,156	USD	37	07/23/2020	(3,042)
UBS AG	BRL	1,005	USD	178	06/02/2020	(10,222)
UBS AG	EUR	2,432	USD	2,629	06/10/2020	(70,945)
						$ 18,551
					Wertsteigerung	$ 151,694
					Wertminderung	$ (133,143)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte					
Morgan Stanley & Co. LLC	CDX-NAHY Series 31, 5 Year Index	12/20/2023	USD 887	$ 21,899	$ 77,279
Verkaufskontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 31, 5 Year Index	12/20/2023	887	(21,899)	(46,678)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 33, 5 Year Index	12/20/2024	16,400	(389,719)	(475,042)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025	2,205	(51,697)	117,442
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Ford Motor Company	06/20/2023	121	(2,893)	17,881
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Ford Motor Company	06/20/2023	69	(1,650)	11,728
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 33, 5 Year Index	06/20/2025	EUR 1,404	47,876	66,548
Insgesamt				$ (398,083)	$ (230,842)
				Wertsteigerung	$ 290,878
				Wertminderung	$ (521,720)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal-betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 430	06/22/2026	1.573%	3 Month LIBOR	$ (29,594)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Markt-wert	Vorab-gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB- Series 6	05/11/2063	USD 217	$ 109,976	$ 41,989	$ 67,987
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	220	111,496	26,951	84,545
Goldman Sachs International	British Telecommunications Public Ltd., Co.	06/20/2020	EUR 360	(156)	(107)	(49)
Verkaufskontrakte						
Credit Suisse International	International Game Technology PLC	06/20/2022	120	2,863	5,598	(2,735)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 182	(60,879)	(12,273)	(48,606)
Goldman Sachs International	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	40	(7,313)	2,865	(10,178)
Goldman Sachs International	Ardagh Packaging Finance Public Ltd., Co.	12/20/2023	EUR 230	27,575	24,861	2,714
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB- Series 6	05/11/2063	USD 142	(71,966)	(25,076)	(46,890)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB- Series 6	05/11/2063	459	(232,776)	(82,344)	(150,432)
JPMorgan Chase Bank, NA	Intrum AB	06/20/2025	EUR 24	(3,889)	(4,215)	326
JPMorgan Chase Bank, NA	Intrum AB	06/20/2025	25	(4,051)	(4,121)	70
JPMorgan Chase Bank, NA	Intrum AB	06/20/2025	49	(7,939)	(8,607)	668
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 250	(83,625)	(14,106)	(69,519)
Insgesamt				$ (220,684)	$ (48,585)	$ (172,099)
					Wertsteigerung	$ 156,310
					Wertminderung	$ (328,409)

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation erhalten					
Barclays Bank PLC					
iBoxx $ Liquid High Yield Index	3,420,000,000	LIBOR Plus 0.00%	USD 3,420	12/20/2020	$ (170,316)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
JPMorgan Chase Bank, NA					
iBoxx $ Liquid High Yield Index	1,267,000	LIBOR Plus 0.00%	1,267	06/20/2020	174,293
iBoxx $ Liquid High Yield Index	3,883,000	LIBOR Plus 0.00%	3,883	06/20/2020	681,841
Insgesamt					$ 685,818
				Wertsteigerung	$ 856,134
				Wertminderung	$ (170,316)
Swaps insgesamt					$ 253,283

(a) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

(b) Not leidendes fälliges Wertpapier.

(c) Zahlungen in Sachwerten (PIK).

(d) Not leidend.

(e) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.

(f) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2020.

(g) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für Derivate zu dienen.

(h) Tagesgeld.

Währungskürzel:

BRL – Brazilian Real
CAD – Canadian Dollar
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
IDR – Indonesian Rupiah
MXN – Mexican Peso
RUB – Russian Ruble
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
CME – Chicago Mercantile Exchange
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
LIBOR – London Interbank Offered Rate
REIT – Real Estate Investment Trust

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Amadeus IT Group SA - Class A	373,335	$ 19,522,212	0.5%
Automatic Data Processing, Inc.	461,833	67,653,916	1.8
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	563,579	44,951,061	1.2
Capgemini SE	244,298	25,234,659	0.7
Fidelity National Information Services, Inc.	364,873	50,655,319	1.3
Mastercard, Inc. - Class A	83,581	25,148,687	0.6
Paychex, Inc.	418,026	30,214,919	0.8
		263,380,773	6.9
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Texas Instruments, Inc.	391,725	46,513,426	1.2
SOFTWARE			
Check Point Software Technologies Ltd.	454,034	49,793,909	1.3
Citrix Systems, Inc.	469,379	69,524,417	1.8
Constellation Software, Inc./Canada	61,366	69,757,612	1.8
Microsoft Corp.	782,871	143,461,111	3.8
Nice Ltd.	224,526	41,663,082	1.1
Oracle Corp.	1,385,904	74,520,058	1.9
Oracle Corp. Japan	542,900	63,518,012	1.7
		512,238,201	13.4
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	262,737	83,534,602	2.2
		905,667,002	23.7
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Anthem, Inc.	106,721	31,387,713	0.8
Galenica AG (a)	427,016	31,633,492	0.8
UnitedHealth Group, Inc.	223,049	67,996,488	1.8
		131,017,693	3.4
PHARMAZEUTIKA			
Astellas Pharma, Inc.	2,375,600	42,447,082	1.1
Bristol-Myers Squibb Co.	542,760	32,413,627	0.8
GlaxoSmithKline PLC	2,140,285	44,331,157	1.2
Johnson & Johnson	292,602	43,524,548	1.1
Merck & Co., Inc.	836,517	67,523,652	1.8
Novo Nordisk A/S - Class B	965,902	63,271,102	1.7
Roche Holding AG	279,808	97,127,449	2.5
		390,638,617	10.2
		521,656,310	13.6
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
PepsiCo, Inc.	304,147	40,010,538	1.1
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	2,387,408	60,530,141	1.6
Walmart, Inc.	594,768	73,786,918	1.9
		134,317,059	3.5
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Morinaga & Co., Ltd./Japan	624,000	26,803,092	0.7
Nestle SA (REG)	377,793	41,019,652	1.1
Salmar ASA	1,051,340	47,411,941	1.2
		115,234,685	3.0
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The)	489,551	56,748,752	1.5
TABAK			
British American Tobacco PLC	807,185	32,013,312	0.8
Philip Morris International, Inc.	695,890	51,050,490	1.3
Swedish Match AB	735,402	51,325,961	1.4
		134,389,763	3.5
		480,700,797	12.6
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	7,933,431	42,137,946	1.1
DBS Group Holdings Ltd.	1,222,000	16,905,749	0.4
JPMorgan Chase & Co.	174,121	16,943,714	0.5
KBC Group NV	474,689	24,905,617	0.7
Royal Bank of Canada (a)	430,621	27,938,682	0.7
		128,831,708	3.4

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
KAPITALMÄRKTE			
CME Group, Inc. - Class A	190,342	$ 34,756,449	0.9%
Partners Group Holding AG	48,953	40,781,508	1.0
S&P Global, Inc.	137,739	44,767,930	1.2
		120,305,887	3.1
VERSICHERUNGEN			
Admiral Group PLC	1,051,236	30,364,436	0.8
American Financial Group, Inc./OH	411,371	24,780,989	0.7
Progressive Corp. (The)	253,013	19,654,050	0.5
Reinsurance Group of America, Inc. - Class A	79,307	7,197,110	0.2
RenaissanceRe Holdings Ltd.	197,345	33,126,332	0.9
Sampo Oyj - Class A	1,090,548	39,183,926	1.0
Swiss Re AG	11,652	795,733	0.0
Zurich Insurance Group AG	51,749	16,746,072	0.4
		171,848,648	4.5
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG			
Essent Group Ltd.	507,973	16,788,508	0.4
		437,774,751	11.4
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	2,542,793	43,861,106	1.2
McDonald's Corp.	248,725	46,342,442	1.2
		90,203,548	2.4
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Amazon.com, Inc.	7,745	18,916,156	0.5
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Dollar General Corp.	343,227	65,731,403	1.7
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	47,260	54,247,864	1.4
Home Depot, Inc. (The)	239,786	59,582,025	1.6
Ross Stores, Inc.	282,893	27,429,305	0.7
TJX Cos., Inc. (The)	366,123	19,316,649	0.5
		160,575,843	4.2
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
adidas AG	131,931	34,989,089	0.9
Deckers Outdoor Corp.	216,316	39,484,160	1.0
		74,473,249	1.9
		409,900,199	10.7
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
L3Harris Technologies, Inc.	323,319	64,485,975	1.7
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
CH Robinson Worldwide, Inc.	598,379	48,546,488	1.2
SG Holdings Co., Ltd.	549,900	17,980,946	0.5
		66,527,434	1.7
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Experian PLC	1,310,296	45,955,359	1.2
Intertrust NV	1,108,491	17,497,431	0.5
RELX PLC	3,593,879	82,939,321	2.2
Verisk Analytics, Inc. - Class A	180,776	31,216,400	0.8
Wolters Kluwer NV	686,715	54,640,802	1.4
		232,249,313	6.1
		363,262,722	9.5
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
American Electric Power Co., Inc.	697,570	59,467,843	1.5
EDP - Energias de Portugal SA	5,757,981	26,898,906	0.7
Enel SpA	7,340,755	56,756,704	1.5
NextEra Energy, Inc.	147,791	37,769,468	1.0
		180,892,921	4.7
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
Tokyo Gas Co., Ltd.	902,400	21,605,227	0.6
MEHRFACH-VERSORGUNGSBETRIEBE			
Ameren Corp.	563,992	42,147,122	1.1
		244,645,270	6.4

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Comcast Corp. - Class A			926,329	$ 36,682,628	1.0%
HKT Trust & HKT Ltd. - Class SS			22,382,000	31,840,608	0.8
Nippon Telegraph & Telephone Corp.			1,683,500	38,318,459	1.0
				106,841,695	2.8
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Alphabet, Inc. - Class C			27,005	38,587,985	1.0
Auto Trader Group PLC			7,604,456	52,857,238	1.4
Facebook, Inc. - Class A			98,347	22,136,926	0.6
				113,582,149	3.0
				220,423,844	5.8
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
Nippon Building Fund, Inc.			6,945	43,435,049	1.1
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Vonovia SE			783,478	45,064,121	1.2
				88,499,170	2.3
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Royal Dutch Shell PLC - Class B			2,081,948	31,784,821	0.8
Gesamtanlagen					
(Kosten $3,434,588,902)				$ 3,704,314,886	96.8%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	0.01 %	–		127,573	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(b)	0.04 %	–		2,747,004	0.1
BBH, Grand Cayman(b)	(0.60)%	–		366,868	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.01 %	–		783,599	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.03 %	–		313,424	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	2.75 %	–		6,034	0.0
Citibank, New York(b)	0.01 %	–		154,780,453	4.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.39)%	–		228,110	0.0
HSBC France S.A., Paris(b)	(0.67)%	–		1,578,143	0.0
MUFG, Tokyo(b)	(0.26)%	–		371,754	0.0
National Australia Bank, London(b)	0.01 %	–		2,358,139	0.1
Nordea Bank Abp, Oslo(b)	(0.25)%	–		2,244,034	0.1
SEB, Stockholm(b)	(0.30)%	–		379,013	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	–		1,814,874	0.1
Termineinlagen insgesamt				168,099,022	4.4
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(44,148,343)	(1.2)
Nettovermögen				$ 3,828,265,565	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	EUR	75,690	USD	82,739	07/17/2020	$ (1,360,185)
Bank of America, NA.	ILS	39,095	USD	11,087	07/17/2020	(55,618)
Bank of America, NA.	NOK	341,104	USD	32,356	07/17/2020	(2,746,171)
Bank of America, NA.	USD	15,022	CAD	20,716	07/17/2020	24,439
Barclays Bank PLC	CHF	13,664	USD	14,142	07/17/2020	(83,276)
Barclays Bank PLC	EUR	8,239	USD	9,004	07/17/2020	(149,929)
Barclays Bank PLC	GBP	14,721	USD	18,273	07/17/2020	88,748
Barclays Bank PLC	JPY	1,195,022	USD	11,189	07/17/2020	100,214
Barclays Bank PLC	USD	7,162	CAD	10,041	07/17/2020	130,772
Barclays Bank PLC	USD	17,233	EUR	15,887	07/17/2020	418,821
Barclays Bank PLC	USD	16,976	JPY	1,830,964	07/17/2020	12,952
BNP Paribas SA	AUD	13,601	USD	8,261	07/17/2020	(805,314)
BNP Paribas SA	CAD	32,175	USD	22,852	07/17/2020	(516,546)
BNP Paribas SA	GBP	26,409	USD	32,328	07/17/2020	(293,372)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	10,999	USD	12,037	07/17/2020	(184,106)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	15,528	AUD	23,814	07/17/2020	345,182
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	22,381	EUR	20,547	07/17/2020	448,653
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	7,196	GBP	5,913	07/17/2020	107,719
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	7,241	JPY	779,157	07/17/2020	(11,468)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	82,021	GBP	66,598	06/12/2020	229,693
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	24,921	NZD	40,948	06/12/2020	496,786
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	9	PLN	37	06/12/2020	417
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	175,020	AUD	265,783	06/22/2020	2,141,029

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	21,717	CAD	30,118	06/22/2020	$ 157,409
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	22,532	CNH	160,737	06/22/2020	(126,292)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	76,126	EUR	69,300	06/22/2020	830,629
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	132,543	SGD	187,507	06/22/2020	183,335
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	21,717	CAD	29,902	06/30/2020	700
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,748	ZAR	30,497	06/30/2020	(15,810)
Citibank, NA	EUR	11,555	USD	12,724	07/17/2020	(115,255)
Citibank, NA	EUR	16,249	USD	18,563	07/17/2020	509,212
Citibank, NA	ILS	26,307	USD	7,510	07/17/2020	11,543
Citibank, NA	JPY	1,562,474	USD	14,539	07/17/2020	40,692
Citibank, NA	USD	15,541	CAD	22,134	07/17/2020	535,395
Citibank, NA	USD	28,880	EUR	26,610	07/17/2020	686,607
Citibank, NA	USD	7,164	ILS	25,336	07/17/2020	56,923
Credit Suisse International	CHF	23,614	USD	24,314	07/17/2020	(270,158)
Credit Suisse International	CHF	10,157	USD	10,619	07/17/2020	44,906
Credit Suisse International	EUR	10,504	USD	11,393	07/17/2020	(278,214)
Credit Suisse International	ILS	55,010	USD	15,382	07/17/2020	(297,317)
Credit Suisse International	SEK	114,980	USD	11,430	07/17/2020	(777,809)
Credit Suisse International	USD	9,758	NOK	96,345	07/17/2020	156,884
Deutsche Bank AG	USD	38,898	JPY	4,177,386	07/17/2020	(136,894)
Goldman Sachs Bank USA	SEK	90,321	USD	9,270	07/17/2020	(319,550)
Goldman Sachs Bank USA	USD	7,221	GBP	5,851	07/17/2020	6,672
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	40,141	USD	50,177	07/17/2020	593,430
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	11,288	AUD	17,421	07/17/2020	324,343
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	7,494	JPY	807,336	07/17/2020	(3,286)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CHF	49,754	USD	51,446	07/17/2020	(351,826)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	18,688	USD	20,226	07/17/2020	(538,677)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	12,262	SEK	114,980	07/17/2020	(54,140)
Royal Bank of Scotland PLC	CHF	14,522	USD	15,007	07/17/2020	(111,860)
Royal Bank of Scotland PLC	ILS	339,167	USD	94,489	07/17/2020	(2,181,026)
Royal Bank of Scotland PLC	USD	7,505	AUD	11,956	07/17/2020	464,908
Royal Bank of Scotland PLC	USD	8,339	JPY	900,604	07/17/2020	17,621
						$ (2,617,465)
					Wertsteigerung	$ 9,166,634
					Wertminderung	$ (11,784,099)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

REG – Registered Shares

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Simplo Technology Co., Ltd.	1,201,000	$ 12,867,116	1.0%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
HCL Technologies Ltd.	1,103,052	8,076,139	0.6
Infosys Ltd. (Sponsored ADR)	3,657,410	33,282,431	2.6
Tata Consultancy Services Ltd.	795,243	20,894,305	1.6
WNS Holdings Ltd. (ADR)	292,840	14,155,886	1.1
		76,408,761	5.9
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Chipbond Technology Corp.	4,958,000	10,190,420	0.8
Novatek Microelectronics Corp.	2,692,000	18,432,293	1.4
Parade Technologies Ltd.	548,000	15,784,085	1.2
Realtek Semiconductor Corp.	1,617,000	13,967,082	1.1
SK Hynix, Inc.	237,250	15,732,664	1.2
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	8,370,000	81,367,069	6.2
		155,473,613	11.9
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Advantech Co., Ltd.	901,000	8,939,896	0.7
Samsung Electronics Co., Ltd.	1,633,650	67,283,641	5.2
		76,223,537	5.9
		320,973,027	24.7
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Fu Shou Yuan International Group Ltd.	12,355,500	11,546,663	0.9
New Oriental Education & Technology Group, Inc. (Sponsored ADR)	92,240	11,065,111	0.8
		22,611,774	1.7
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Midea Group Co., Ltd. - Class A	1,502,213	12,478,750	1.0
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	80,600	2,084,066	0.2
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	480,150	99,578,308	7.6
JD.com, Inc. (ADR)	200,830	10,911,094	0.8
		112,573,468	8.6
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Topsports International Holdings Ltd.	11,490,800	16,437,556	1.3
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	757,500	3,919,173	0.3
		20,356,729	1.6
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
ANTA Sports Products Ltd.	2,295,000	20,567,846	1.6
Feng TAY Enterprise Co., Ltd.	1,509,000	9,125,541	0.7
Hermes International	6,760	5,649,315	0.4
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	17,660	7,408,818	0.6
Moncler SpA	161,279	6,043,284	0.5
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	500,000	6,016,707	0.4
		54,811,511	4.2
		222,832,232	17.1
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Cia Cervecerias Unidas SA	1,167,120	8,439,893	0.7
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	215,906	41,431,683	3.2
Pernod Ricard SA	26,170	4,078,245	0.3
		53,949,821	4.2
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Wal-Mart de Mexico SAB de CV	8,990,030	22,500,921	1.7
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Nestle SA (REG)	356,180	38,672,976	3.0
Uni-President Enterprises Corp.	3,860,000	9,369,160	0.7
		48,042,136	3.7
HAUSHALTSPRODUKTE			
Colgate-Palmolive Co.	115,140	8,328,076	0.6
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Unilever PLC	241,720	12,978,820	1.0

		Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
TABAK				
	ITC Ltd.	3,710,250	$ 9,678,415	0.8%
	Philip Morris International, Inc.	212,620	15,597,803	1.2
			25,276,218	2.0
			171,075,992	13.2
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN				
UNTERHALTUNG				
	NCSoft Corp.	49,230	31,447,220	2.4
	NetEase, Inc. (ADR)	50,790	19,447,491	1.5
			50,894,711	3.9
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN				
	Tencent Holdings Ltd.	1,734,300	93,922,522	7.2
MEDIEN				
	Cheil Worldwide, Inc.	561,579	7,549,457	0.6
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE				
	China Mobile Ltd.	1,540,000	10,888,945	0.8
			163,255,635	12.5
FINANZWERTE				
BANKEN				
	Bank Central Asia Tbk PT	7,628,500	13,574,058	1.0
	Credicorp Ltd.	90,570	12,482,358	1.0
	CTBC Financial Holding Co., Ltd.	12,592,000	8,392,973	0.6
	HDFC Bank Ltd.	591,908	7,458,998	0.6
	Komercni banka as	183,730	3,937,074	0.3
	Moneta Money Bank AS	5,301,760	11,790,808	0.9
	Shinhan Financial Group Co., Ltd.	256,600	6,271,782	0.5
			63,908,051	4.9
KAPITALMÄRKTE				
	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	487,000	4,156,972	0.3
VERSICHERUNGEN				
	AIA Group Ltd.	2,976,800	24,426,973	1.9
	BB Seguridade Participacoes SA	2,260,000	10,706,445	0.8
	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	4,420,500	43,745,831	3.4
			78,879,249	6.1
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG				
	Housing Development Finance Corp., Ltd.	505,262	11,201,164	0.9
			158,145,436	12.2
VERSORGUNG				
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE				
	Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista (Preference Shares)	3,490,600	13,605,771	1.0
	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	1,677,200	8,970,127	0.7
			22,575,898	1.7
GASVERSORGUNGSBETRIEBE				
	China Resources Gas Group Ltd.	4,278,000	23,435,921	1.8
	ENN Energy Holdings Ltd.	1,480,000	17,375,220	1.3
			40,811,141	3.1
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN				
	China Yangtze Power Co., Ltd. - Class A	13,378,024	32,615,613	2.5
	Engie Brasil Energia SA	753,000	5,984,433	0.5
			38,600,046	3.0
WASSERVERSORGER				
	Guangdong Investment Ltd.	12,220,000	24,164,137	1.9
			126,151,222	9.7
ENERGIE				
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE				
	LUKOIL PJSC (Sponsored ADR)	384,606	28,956,985	2.2
	Petronet LNG Ltd.	8,066,068	27,314,397	2.1
			56,271,382	4.3
GRUNDSTOFFE				
CHEMIKALIEN				
	Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd. - Class H	7,750,000	1,929,302	0.2
BAUMATERIAL				
	Anhui Conch Cement Co., Ltd. - Class H	1,745,000	13,158,166	1.0
			15,087,468	1.2
IMMOBILIEN				
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG				
	Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	1,690,000	8,007,229	0.6

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Gesamtanlagen				
(Kosten $1,189,280,713)			$ 1,241,799,623	95.5%
Termineinlagen				
BBH, Grand Cayman(a)	(0.26)%	–	652	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	0.01 %	–	9	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	0.03 %	–	190,168	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	2.75 %	–	129,674	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(a)	(1.39)%	–	126,206	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(a)	(0.67)%	–	126,858	0.0
HSBC Bank PLC, London(a)	0.01 %	–	127,985	0.0
JPMorgan Chase, New York(a)	0.01 %	–	52,574,798	4.1
Nordea Bank Abp, Oslo(a)	(0.25)%	–	140,881	0.0
Termineinlagen insgesamt			53,417,231	4.1
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			5,238,169	0.4
Nettovermögen			$ 1,300,455,023	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	124	AUD	192	06/12/2020	$ 3,589
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	7	CAD	10	06/12/2020	115
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14	EUR	13	06/12/2020	335
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14	GBP	11	06/12/2020	35
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6	NZD	11	06/12/2020	133
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	16	SGD	22	06/12/2020	44
						$ 4,251

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
NZD – New Zealand Dollar
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
PJSC – Public Joint Stock Company
REG – Registered Shares

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Anglo American Capital PLC	3.38%	03/11/2029	GBP	2,540	£ 2,566,902	0.3%
Braskem Finance Ltd.	6.45%	02/03/2024	USD	1,750	1,486,969	0.2
DuPont de Nemours, Inc.(a)	1.10%	11/15/2020		4,215	3,414,483	0.4
Glencore Finance Europe Ltd.	3.13%	03/26/2026	GBP	2,795	2,730,993	0.3
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024	USD	630	549,975	0.1
LYB International Finance II BV	1.88%	03/02/2022	EUR	4,355	3,948,066	0.4
					14,697,388	1.7
INVESTITIONSGÜTER						
BAE Systems PLC	4.13%	06/08/2022	GBP	3,230	3,397,013	0.4
Caterpillar Financial Services Corp.(a)	0.90%	05/15/2023	USD	700	559,955	0.1
Caterpillar Financial Services Corp.(a)	0.97%	03/15/2021		2,360	1,910,497	0.2
CNH Industrial Finance Europe SA.	1.75%	09/12/2025	EUR	180	159,767	0.0
CNH Industrial Finance Europe SA, Series G	2.88%	05/17/2023		2,085	1,934,480	0.2
CRH Finland Services Oyj.	0.88%	11/05/2023		279	251,640	0.0
Dover Corp.	0.75%	11/04/2027		2,775	2,337,664	0.3
Eaton Capital Unlimited Co.	0.70%	05/14/2025		1,372	1,228,341	0.2
General Electric Co.	3.45%	05/01/2027	USD	423	340,465	0.0
General Electric Co.	6.25%	09/29/2020	GBP	1,920	1,946,844	0.2
John Deere Cash Management SA.	1.38%	04/02/2024	EUR	2,485	2,287,956	0.3
Johnson Controls International PLC	1.00%	09/15/2023		4,809	4,321,418	0.5
Parker-Hannifin Corp.	1.13%	03/01/2025		2,795	2,504,605	0.3
Rolls-Royce PLC	2.38%	10/14/2020	USD	1,445	1,166,830	0.1
Siemens Financieringsmaatschappij NV	1.00%	02/20/2025	GBP	3,700	3,721,228	0.4
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.(a)	2.04%	09/15/2021	USD	2,265	1,744,638	0.2
					29,813,341	3.4
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Fox Corp.	3.05%	04/07/2025		52	44,901	0.0
Fox Corp.	4.03%	01/25/2024		1,086	965,214	0.1
Prosus NV	3.68%	01/21/2030		2,198	1,842,327	0.2
Sky Ltd.	1.88%	11/24/2023	EUR	3,150	2,965,252	0.4
ViacomCBS, Inc.	4.75%	05/15/2025	USD	3,765	3,339,121	0.4
					9,156,815	1.1
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Arqiva Financing PLC	4.04%	06/30/2020	GBP	1,065	1,065,482	0.1
AT&T, Inc.	5.50%	03/15/2027		2,500	3,044,198	0.4
AT&T, Inc., Series B(b)	2.88%	03/02/2025	EUR	600	507,761	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	USD	1,570	2,003,849	0.2
CK Hutchison Group Telecom Finance SA	0.38%	10/17/2023	EUR	2,019	1,787,025	0.2
Orange SA	7.25%	11/10/2020	GBP	489	502,149	0.1
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025	USD	3,220	2,765,956	0.3
Verizon Communications, Inc.(a)	1.32%	02/17/2023	AUD	2,050	1,098,995	0.1
Vodafone Group PLC(a)	2.17%	01/16/2024	USD	1,211	968,598	0.1
					13,744,013	1.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
American Honda Finance Corp.	1.60%	04/20/2022	EUR	443	403,012	0.0
American Honda Finance Corp.	2.63%	10/14/2022	GBP	2,834	2,894,362	0.3
Aptiv Corp.	4.15%	03/15/2024	USD	266	227,131	0.0
BMW Finance NV	0.88%	08/16/2022	GBP	1,400	1,373,565	0.2
BMW US Capital LLC(a)	0.93%	08/13/2021	USD	1,200	959,615	0.1
BMW US Capital LLC(a)	1.72%	04/12/2021		860	689,923	0.1
Daimler Finance North America LLC(a)	0.81%	02/22/2021		1,075	858,405	0.1
Daimler International Finance BV	1.50%	08/18/2021	GBP	2,200	2,183,248	0.2
Dongfeng Motor Hong Kong International Co., Ltd.	1.15%	10/23/2021	EUR	1,191	1,069,164	0.1
General Motors Co.	6.13%	10/01/2025	USD	31	27,361	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027		238	219,982	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	3.95%	04/13/2024		2,390	1,937,939	0.2
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	0.90%	11/19/2024	EUR	2,277	1,858,241	0.2
Harley-Davidson Financial Services, Inc.(a)	2.52%	03/02/2021	USD	1,925	1,534,432	0.2
Hyundai Capital America(a)	1.89%	09/18/2020		856	689,456	0.1
Hyundai Capital America.	2.85%	11/01/2022		1,695	1,365,999	0.2
Hyundai Capital Services, Inc.	3.50%	06/03/2021	AUD	920	499,394	0.1
Hyundai Capital Services, Inc.	3.50%	03/30/2022		1,435	785,869	0.1
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027	USD	1,334	1,030,609	0.1
Nissan Motor Acceptance Corp.(a)	1.96%	07/13/2022		1,000	714,556	0.1
Nissan Motor Acceptance Corp.	2.55%	03/08/2021		950	747,513	0.1
Toyota Motor Finance Netherlands BV	1.38%	05/23/2023	GBP	1,780	1,776,049	0.2
Volkswagen Financial Services NV	1.50%	04/12/2021		3,190	3,177,405	0.4
					27,023,230	3.1

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover-mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG						
Carnival Corp.	1.63%	02/22/2021	EUR	1,180	£ 978,942	0.1%
Carnival Corp.	1.88%	11/07/2022		2,735	1,896,076	0.2
					2,875,018	0.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Marriott International, Inc./MD(a)	1.65%	03/08/2021	USD	515	410,732	0.0
Marriott International, Inc./MD	5.75%	05/01/2025		136	119,272	0.0
Marriott International, Inc./MD, Series Y(a)	2.18%	12/01/2020		1,786	1,428,162	0.2
					1,958,166	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1.00%	02/11/2023	GBP	2,800	2,808,735	0.3
Next Group PLC	3.00%	08/26/2025		1,480	1,437,207	0.1
TJX Cos., Inc. (The)	3.50%	04/15/2025	USD	518	467,801	0.1
Walgreens Boots Alliance, Inc.	2.88%	11/20/2020	GBP	615	616,867	0.1
					5,330,610	0.6
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Abbott Ireland Financing DAC	0.88%	09/27/2023	EUR	2,033	1,859,630	0.2
AbbVie, Inc.(a)	1.02%	11/21/2022	USD	4,720	3,790,440	0.4
Altria Group, Inc.	1.70%	06/15/2025	EUR	776	712,631	0.1
Altria Group, Inc.	2.20%	06/15/2027		1,571	1,469,216	0.2
Altria Group, Inc.	3.40%	05/06/2030	USD	481	410,832	0.1
Anheuser-Busch InBev SA/NV	9.75%	07/30/2024	GBP	2,735	3,666,916	0.4
AstraZeneca PLC(a)	1.05%	08/17/2023	USD	1,838	1,469,091	0.2
AstraZeneca PLC(a)	1.52%	06/10/2022		558	449,399	0.1
BAT Capital Corp.(a)	1.27%	08/15/2022		1,067	845,642	0.1
BAT Capital Corp.	4.70%	04/02/2027		731	663,315	0.1
BAT International Finance PLC	1.75%	07/05/2021	GBP	1,285	1,288,189	0.2
Baxter International, Inc.	0.40%	05/15/2024	EUR	2,616	2,346,066	0.3
Baxter International, Inc.	1.30%	05/30/2025		1,363	1,268,713	0.1
Bayer US Finance II LLC(a)	1.85%	06/25/2021	USD	1,500	1,207,786	0.1
Bayer US Finance II LLC	3.50%	06/25/2021		500	413,630	0.1
Coca-Cola European Partners PLC	0.75%	02/24/2022	EUR	4,270	3,854,230	0.4
CVS Health Corp.(a)	1.72%	03/09/2021	USD	4,200	3,403,661	0.4
DH Europe Finance II SARL	0.45%	03/18/2028	EUR	1,130	982,590	0.1
GlaxoSmithKline Capital PLC(a)	0.77%	05/14/2021	USD	2,414	1,956,456	0.2
Heineken NV	3.40%	04/01/2022		1,043	879,662	0.1
Johnson & Johnson	5.50%	11/06/2024	GBP	3,050	3,673,159	0.4
Medtronic Global Holdings SCA	0.25%	07/02/2025	EUR	423	376,890	0.0
Medtronic Global Holdings SCA	0.38%	03/07/2023		2,155	1,938,668	0.2
Mondelez International, Inc.	2.13%	04/13/2023	USD	2,530	2,117,068	0.2
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	1.13%	11/21/2022	EUR	4,315	3,928,679	0.5
Tesco Corporate Treasury Services PLC	2.50%	05/02/2025	GBP	1,975	2,054,493	0.2
Wm Morrison Supermarkets PLC	3.50%	07/27/2026		2,695	2,968,458	0.3
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	3.05%	01/15/2026	USD	1,756	1,504,335	0.2
					51,499,845	5.9
ENERGIE						
BG Energy Capital PLC	5.13%	12/01/2025	GBP	3,022	3,628,284	0.4
Boardwalk Pipelines LP	4.45%	07/15/2027	USD	1,890	1,464,893	0.2
BP Capital Markets PLC	1.11%	02/16/2023	EUR	4,670	4,245,447	0.5
Ecopetrol SA	5.88%	09/18/2023	USD	2,520	2,199,542	0.2
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027		1,335	1,092,963	0.1
Energy Transfer Operating LP	4.50%	04/15/2024		1,123	958,862	0.1
Energy Transfer Operating LP	4.90%	02/01/2024		1,567	1,342,903	0.2
Energy Transfer Partners LP/Regency Energy Finance Corp.	4.50%	11/01/2023		785	666,190	0.1
Eni SpA	4.15%	10/01/2020		1,405	1,142,834	0.1
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR	90,000	916,759	0.1
Kinder Morgan, Inc./DE(a)	2.50%	01/15/2023	USD	2,950	2,347,201	0.3
Marathon Petroleum Corp.	4.70%	05/01/2025		1,609	1,440,426	0.2
Oleoducto Central SA	4.00%	05/07/2021		925	752,733	0.1
ONEOK, Inc.	4.00%	07/13/2027		2,235	1,784,474	0.2
ONEOK, Inc.	5.85%	01/15/2026		499	445,843	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.55%	12/15/2029		496	376,869	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.60%	11/01/2024		1,575	1,276,400	0.1
Saudi Arabian Oil Co.	2.88%	04/16/2024		2,795	2,335,579	0.3
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026		809	658,541	0.1
Total Capital International SA	1.66%	07/22/2026	GBP	3,800	3,863,030	0.4
Valero Energy Corp.	6.63%	06/15/2037	USD	1,805	1,891,458	0.2
					34,831,231	4.0
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
CK Hutchison Finance 16 Ltd., Series A	1.25%	04/06/2023	EUR	3,680	3,340,268	0.4

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover-mögen %
DIENSTLEISTUNGEN						
eBay, Inc.	1.90%	03/11/2025	USD	2,707	£ 2,214,964	0.3%
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025		290	250,846	0.0
Expedia Group, Inc.	7.00%	05/01/2025		360	311,722	0.0
					2,777,532	0.3
TECHNOLOGIE						
Analog Devices, Inc.	2.95%	04/01/2025		229	196,414	0.0
Baidu, Inc.	3.88%	09/29/2023		2,500	2,151,442	0.3
Broadcom, Inc.	4.25%	04/15/2026		286	248,014	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	0.63%	12/03/2025	EUR	307	273,299	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	0.75%	05/21/2023		2,313	2,090,236	0.3
Fiserv, Inc.	0.38%	07/01/2023		1,770	1,576,603	0.2
Hewlett Packard Enterprise Co.(a)	1.46%	03/12/2021	USD	1,305	1,051,029	0.1
Hewlett Packard Enterprise Co.(a)	2.09%	10/05/2021		1,132	904,669	0.1
International Business Machines Corp.	0.38%	01/31/2023	EUR	3,300	2,966,486	0.4
KLA Corp.	4.65%	11/01/2024	USD	2,125	1,942,883	0.2
Leidos, Inc.	3.63%	05/15/2025		235	204,247	0.0
LG Display Co., Ltd.	3.88%	11/15/2021		1,096	919,427	0.1
NXP BV/NXP Funding LLC	3.88%	09/01/2022		440	372,690	0.1
NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA, Inc.	2.70%	05/01/2025		346	287,962	0.0
					15,185,401	1.8
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN						
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025		1,017	852,279	0.1
Southwest Airlines Co.	4.75%	05/04/2023		1,796	1,475,546	0.2
Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025		880	724,006	0.1
					3,051,831	0.4
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN						
Pacific National Finance Pty Ltd.	5.00%	09/19/2023	GBP	2,780	3,027,961	0.3
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	USD	2,265	1,723,968	0.2
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022		175	118,974	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027		156	87,194	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023		575	370,928	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025		203	118,630	0.0
DP World Crescent Ltd.	4.85%	09/26/2028		2,240	1,861,376	0.2
FedEx Corp.	0.70%	05/13/2022	EUR	4,293	3,843,422	0.5
Heathrow Funding Ltd.	7.13%	02/14/2024	GBP	1,690	1,891,063	0.2
					10,015,555	1.2
					228,328,205	26.3
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
ABN AMRO Bank NV	4.75%	07/28/2025	USD	3,003	2,635,496	0.3
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025		1,260	1,060,150	0.1
AIB Group PLC	4.75%	10/12/2023		1,875	1,598,413	0.2
American Express Co.(a)	0.91%	05/17/2021		2,167	1,755,782	0.2
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	4.40%	05/19/2026		2,460	2,172,714	0.3
Banco Santander SA	2.75%	09/12/2023	GBP	2,000	2,059,920	0.2
Bank of Ireland Group PLC	4.50%	11/25/2023	USD	3,290	2,771,653	0.3
Bank of New York Mellon Corp. (The), Series G(b)	4.70%	09/20/2025		831	691,482	0.1
Bank of Nova Scotia (The)	1.38%	12/05/2023	GBP	1,781	1,784,991	0.2
Banque Federative du Credit Mutuel SA	2.25%	12/18/2023		1,900	1,964,088	0.2
Barclays PLC	2.38%	10/06/2023		795	798,483	0.1
Barclays PLC	3.13%	01/17/2024		1,349	1,389,204	0.2
Barclays PLC	3.38%	04/02/2025	EUR	1,450	1,393,225	0.2
BNP Paribas SA	1.88%	12/14/2027	GBP	1,900	1,872,833	0.2
BPCE SA(a)	2.02%	09/12/2023	USD	4,995	3,986,622	0.5
CaixaBank SA	1.75%	10/24/2023	EUR	2,900	2,611,491	0.3
Capital One Financial Corp.	0.80%	06/12/2024		1,377	1,171,136	0.1
Capital One Financial Corp.	1.65%	06/12/2029		1,935	1,598,088	0.2
Citigroup, Inc.	1.25%	07/06/2026		2,155	1,957,707	0.2
Citigroup, Inc.	1.50%	07/24/2026		180	165,855	0.0
Citigroup, Inc.	2.75%	01/24/2024	GBP	1,604	1,667,576	0.2
Commonwealth Bank of Australia	4.50%	12/09/2025	USD	827	740,243	0.1
Cooperatieve Rabobank UA	3.95%	11/09/2022		950	807,085	0.1
Cooperatieve Rabobank UA	4.63%	12/01/2023		555	490,186	0.1
Cooperatieve Rabobank UA	5.25%	09/14/2027	GBP	1,595	1,887,883	0.2
Credit Suisse Group AG.	2.13%	09/12/2025		797	805,720	0.1
Danske Bank A/S	2.25%	01/14/2028		1,100	1,080,600	0.1
Danske Bank A/S	3.24%	12/20/2025	USD	798	660,326	0.1
Danske Bank A/S	5.38%	01/12/2024		203	179,894	0.0
DNB Bank ASA(b)	6.50%	03/26/2022		2,295	1,915,959	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	7.13%	08/07/2025	GBP	2,845	3,605,690	0.4

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (GBP)	Nettover-mögen %
	HSBC Holdings PLC	3.00%	07/22/2028	GBP	636	£	664,023	0.1%
	HSBC Holdings PLC	4.25%	03/14/2024	USD	2,226		1,925,367	0.2
	HSBC Holdings PLC, Series E(b)	4.75%	07/04/2029	EUR	1,185		1,022,494	0.1
	ING Groep NV	3.00%	02/18/2026	GBP	1,800		1,918,573	0.2
	ING Groep NV(b)	6.88%	04/16/2022	USD	2,235		1,860,085	0.2
	Intesa Sanpaolo SpA	2.50%	01/15/2030	GBP	1,480		1,386,056	0.2
	Intesa Sanpaolo SpA	3.13%	07/14/2022	USD	2,380		1,943,631	0.2
	Lloyds Bank PLC	7.50%	04/15/2024	GBP	1,520		1,859,050	0.2
	Macquarie Group Ltd.	0.63%	02/03/2027	EUR	2,205		1,887,247	0.2
	Mizuho Financial Group, Inc.(a)	1.31%	02/28/2022	USD	1,104		888,708	0.1
	Mizuho Financial Group, Inc.(a)	1.65%	09/11/2022		1,140		911,604	0.1
	Morgan Stanley	1.88%	03/30/2023	EUR	3,055		2,844,036	0.3
	Morgan Stanley, Series G	1.00%	12/02/2022		1,000		907,172	0.1
	Nordea Bank Abp(a)	1.30%	08/30/2023	USD	1,825		1,456,053	0.2
	Royal Bank of Scotland Group PLC(a)	1.86%	05/15/2023		1,340		1,068,577	0.1
	Royal Bank of Scotland Group PLC	2.88%	09/19/2026	GBP	1,795		1,846,802	0.2
	Santander UK PLC	5.00%	11/07/2023	USD	3,489		3,013,301	0.4
	Societe Generale SA	5.00%	01/17/2024		4,715		4,051,718	0.5
	Standard Chartered PLC(a) (b)	2.27%	01/30/2027		2,800		1,791,991	0.2
	Standard Chartered PLC	5.70%	01/25/2022		777		661,948	0.1
	Swedbank AB(b)	6.00%	03/17/2022		600		486,294	0.1
	Swedbank AB, Series NC5(b)	5.63%	09/17/2024		2,600		2,090,342	0.2
	UBS Group AG(b)	5.75%	02/19/2022	EUR	2,115		1,974,944	0.2
	UniCredit SpA	3.75%	04/12/2022	USD	3,890		3,191,114	0.4
	Wells Fargo & Co.	1.65%	06/02/2024		630		511,838	0.1
	Wells Fargo & Co.	2.13%	12/20/2023	GBP	3,744		3,797,761	0.4
							95,241,224	11.0
MAKLER								
	Charles Schwab Corp. (The), Series G(b)	5.38%	06/01/2025	USD	1,165		990,135	0.1
VERSICHERUNGEN								
	Alleghany Corp.	3.63%	05/15/2030		1,975		1,665,212	0.2
	American International Group, Inc.	5.00%	04/26/2023	GBP	2,600		2,842,753	0.3
	Aon PLC	2.88%	05/14/2026	EUR	2,338		2,292,596	0.3
	Assicurazioni Generali SpA	5.00%	06/08/2048		2,186		2,153,754	0.2
	Caisse Nationale de Reassurance Mutuelle Agricole Groupama	6.00%	01/23/2027		1,300		1,407,747	0.2
	Centene Corp.	4.25%	12/15/2027	USD	685		579,821	0.1
	Chubb INA Holdings, Inc.	0.30%	12/15/2024	EUR	601		528,606	0.1
	Chubb INA Holdings, Inc.	0.88%	06/15/2027		2,545		2,265,575	0.2
	Credit Agricole Assurances SA	4.75%	09/27/2048		1,100		1,151,324	0.1
	Friends Life Holdings PLC	8.25%	04/21/2022	GBP	1,550		1,730,021	0.2
	Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	6.63%	05/26/2042		900		975,261	0.1
							17,592,670	2.0
SONSTIGE FINANZWERTE								
	Digital Dutch Finco BV	1.50%	03/15/2030	EUR	567		507,017	0.1
REITS								
	CyrusOne LP/CyrusOne Finance Corp.	1.45%	01/22/2027		557		462,562	0.1
	Digital Euro Finco LLC	2.50%	01/16/2026		1,383		1,322,926	0.1
	Digital Stout Holding LLC	4.75%	10/13/2023	GBP	695		759,997	0.1
	EPR Properties	5.25%	07/15/2023	USD	1,400		1,040,804	0.1
	Equinix, Inc.	2.88%	10/01/2025	EUR	2,020		1,845,328	0.2
	WPC Eurobond BV	2.13%	04/15/2027		1,978		1,733,321	0.2
							7,164,938	0.8
							121,495,984	14.0
VERSORGUNGSBETRIEBE								
ELEKTRIZITÄT								
	Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	3.63%	06/22/2021	USD	1,534		1,267,724	0.2
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc., Series C(a)	1.62%	06/25/2021		1,485		1,200,792	0.1
	Duke Energy Corp.(a)	0.92%	05/14/2021		1,210		978,088	0.1
	EDP Finance BV	5.25%	01/14/2021		1,640		1,356,712	0.2
	EDP Finance BV, Series E	8.63%	01/04/2024	GBP	875		1,072,560	0.1
	Enel Finance International NV	0.00%	06/17/2024	EUR	2,212		1,944,041	0.2
	Enel Finance International NV	2.65%	09/10/2024	USD	2,490		2,086,692	0.2
	Florida Power & Light Co.	2.85%	04/01/2025		358		315,823	0.0
	Iberdrola Finanzas SA	7.38%	01/29/2024	GBP	3,000		3,649,952	0.4
	innogy Finance BV	5.63%	12/06/2023		2,440		2,791,795	0.3
	Korea Southern Power Co., Ltd.	3.00%	01/29/2021	USD	2,168		1,777,957	0.2
	Western Power Distribution East Midlands PLC	5.25%	01/17/2023	GBP	3,500		3,851,925	0.5
	Western Power Distribution South Wales PLC	9.25%	11/09/2020		360		372,144	0.1
							22,666,205	2.6

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (GBP)	Nettover-mögen %
ERDGAS								
	Centrica PLC	4.38%	03/13/2029	GBP	1,440	£	1,681,476	0.2%
	National Grid North America, Inc.	0.75%	08/08/2023	EUR	3,015		2,725,950	0.3
	Southern Gas Networks PLC, Series A5	4.88%	12/21/2020	GBP	1,011		1,030,177	0.1
							5,437,603	0.6
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE								
	Anglian Water Services Financing PLC	4.50%	02/22/2026		2,720		2,962,195	0.4
	Thames Water Utilities Finance PLC	1.88%	01/24/2024		377		380,725	0.1
	Thames Water Utilities Finance PLC	5.05%	06/30/2020		1,950		1,955,270	0.2
	Veolia Environnement SA	0.89%	01/14/2024	EUR	4,100		3,742,526	0.4
							9,040,716	1.1
							37,144,524	4.3
							386,968,713	44.6
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE								
AUSTRALIEN								
	Australia Government Bond, Series 150	3.00%	03/21/2047	AUD	14,405		9,888,362	1.1
KANADA								
	Province of Ontario Canada	0.50%	12/15/2023	GBP	7,779		7,772,278	0.9
CHINA								
	China Government Bond, Series INBK	3.39%	03/16/2050	CNY	12,120		1,348,033	0.2
ITALIEN								
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.35%	02/01/2025	EUR	12,648		11,082,870	1.3
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.85%	07/01/2025		16,145		15,095,686	1.7
							26,178,556	3.0
SÜDKOREA								
	Korea Treasury Bond, Series 2503	1.50%	03/10/2025	KRW	26,256,290		17,472,534	2.0
SPANIEN								
	Spain Government Bond	1.95%	04/30/2026	EUR	16,340		16,330,008	1.9
							78,989,771	9.1
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN								
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH								
	Bellemeade Re Ltd.							
	Series 2019-3A, Class M1B(a)	1.77%	07/25/2029	USD	726		521,544	0.1
	Series 2019-4A, Class M1C(a)	2.67%	10/25/2029		1,394		990,834	0.1
	Connecticut Avenue Securities Trust							
	Series 2018-R07, Class 1M2(a)	2.57%	04/25/2031		864		687,139	0.1
	Series 2019-R03, Class 1M2(a)	2.32%	09/25/2031		1,628		1,288,310	0.1
	Series 2019-R05, Class 1M2(a)	2.17%	07/25/2039		1,301		1,033,757	0.1
	Series 2019-R06, Class 2M2(a)	2.27%	09/25/2039		1,053		831,034	0.1
	Series 2019-R07, Class 1M2(a)	2.27%	10/25/2039		1,960		1,495,867	0.2
	Series 2020-R02, Class 2M1(a)	0.92%	01/25/2040		714		570,870	0.1
	Eagle RE Ltd., Series 2018-1, Class M1(a)	1.87%	11/25/2028		447		347,002	0.0
	Federal Home Loan Mortgage Corp Structured Agency Credit Risk Debt Notes							
	Series 2013-DN2, Class M2(a)	4.42%	11/25/2023		1,995		1,260,114	0.1
	Series 2014-DN3, Class M3(a)	4.17%	08/25/2024		1,240		1,015,746	0.1
	Series 2016-DNA4, Class M3(a)	3.97%	03/25/2029		695		582,443	0.1
	Series 2016-HQA3, Class M3(a)	4.02%	03/25/2029		1,200		989,863	0.1
	Series 2016-HQA4, Class M3(a)	4.07%	04/25/2029		1,740		1,437,059	0.2
	Series 2019-DNA3, Class M2(a)	2.22%	07/25/2049		210		163,064	0.0
	Series 2020-DNA1, Class M2(a)	1.87%	01/25/2050		1,955		1,432,314	0.2
	Series 2020-HQA2, Class M2(a)	3.27%	03/25/2050		548		370,059	0.0
	Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes							
	Series 2014-DN1, Class M2(a)	2.37%	02/25/2024		301		233,625	0.0
	Series 2014-DN1, Class M3(a)	4.67%	02/25/2024		1,125		758,533	0.1
	Series 2014-DN2, Class M3(a)	3.77%	04/25/2024		910		611,579	0.1
	Series 2014-HQ1, Class M3(a)	4.27%	08/25/2024		968		789,666	0.1
	Series 2015-DNA1, Class M2(a)	2.02%	10/25/2027		674		544,402	0.1
	Series 2016-DNA1, Class M3(a)	5.72%	07/25/2028		2,197		1,902,494	0.2
	Series 2016-DNA2, Class M3(a)	4.82%	10/25/2028		1,648		1,395,509	0.2
	Series 2016-DNA3, Class M3(a)	5.17%	12/25/2028		1,981		1,680,825	0.2
	Series 2016-HQA1, Class M3(a)	6.52%	09/25/2028		3,151		2,680,720	0.3
	Series 2017-DNA1, Class M1(a)	1.37%	07/25/2029		78		63,248	0.0
	Series 2017-DNA2, Class M1(a)	1.37%	10/25/2029		476		384,292	0.0
	Series 2017-DNA2, Class M2(a)	3.62%	10/25/2029		1,880		1,547,933	0.2
	Series 2017-DNA3, Class M2(a)	2.67%	03/25/2030		1,219		987,135	0.1
	Series 2017-HQA1, Class M2(a)	3.72%	08/25/2029		2,699		2,191,910	0.3
	Series 2017-HQA2, Class M2(a)	2.82%	12/25/2029		938		761,212	0.1
	Series 2018-HQA1, Class M2(a)	2.47%	09/25/2030		1,350		1,019,014	0.1

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (GBP)	Nettover-mögen %
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities, Series 2016-C06, Class 1M2B(a)	4.42%	04/25/2029	USD	1,030	£	835,640	0.1%
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities							
Series 2014-C03, Class 1M2(a)	3.17%	07/25/2024		917		571,716	0.1
Series 2014-C03, Class 2M2(a)	3.07%	07/25/2024		912		686,804	0.1
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	5.07%	11/25/2024		2,650		2,215,413	0.3
Series 2014-C04, Class 2M2(a)	5.17%	11/25/2024		1,103		892,479	0.1
Series 2015-C01, Class 1M2(a)	4.47%	02/25/2025		1,088		840,873	0.1
Series 2015-C02, Class 1M2(a)	4.17%	05/25/2025		1,658		1,268,067	0.1
Series 2015-C02, Class 2M2(a)	4.17%	05/25/2025		581		463,324	0.1
Series 2015-C03, Class 2M2(a)	5.17%	07/25/2025		820		671,386	0.1
Series 2015-C04, Class 1M2(a)	5.87%	04/25/2028		52		44,586	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(a)	5.72%	04/25/2028		1,031		878,252	0.1
Series 2016-C01, Class 1M2(a)	6.92%	08/25/2028		2,161		1,848,395	0.2
Series 2016-C01, Class 2M2(a)	7.12%	08/25/2028		1,225		1,071,920	0.1
Series 2016-C02, Class 1M2(a)	6.17%	09/25/2028		2,105		1,782,401	0.2
Series 2016-C03, Class 2M2(a)	6.07%	10/25/2028		1,474		1,263,536	0.1
Series 2016-C04, Class 1M2(a)	4.42%	01/25/2029		463		386,679	0.0
Series 2016-C05, Class 2M2(a)	4.62%	01/25/2029		1,414		1,178,567	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(a)	4.42%	04/25/2029		2,459		2,055,171	0.2
Series 2016-C07, Class 2M2(a)	4.52%	05/25/2029		1,493		1,239,295	0.1
Series 2017-C01, Class 1M2(a)	3.72%	07/25/2029		1,489		1,221,603	0.1
Series 2017-C02, Class 2M2(a)	3.82%	09/25/2029		2,017		1,632,812	0.2
Series 2017-C04, Class 2M2(a)	3.02%	11/25/2029		1,092		868,617	0.1
Series 2017-C05, Class 1M2(a)	2.37%	01/25/2030		1,055		827,431	0.1
Series 2017-C06, Class 1M2(a)	2.82%	02/25/2030		1,795		1,424,979	0.2
Series 2017-C06, Class 2M2(a)	2.97%	02/25/2030		1,970		1,551,212	0.2
Series 2018-C01, Class 1M2(a)	2.42%	07/25/2030		1,827		1,438,786	0.2
Radnor Re Ltd.							
Series 2019-1, Class M1B(a)	2.12%	02/25/2029		530		415,620	0.0
Series 2019-1, Class M2(a)	3.37%	02/25/2029		1,647		1,095,311	0.1
STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class M2(a)	2.27%	09/25/2048		1,939		1,493,500	0.2
						64,733,491	7.4
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH							
Bear Stearns ARM Trust							
Series 2007-3, Class 1A1	3.85%	05/25/2047		117		86,881	0.0
Series 2007-4, Class 22A1	3.92%	06/25/2047		659		474,942	0.1
Residential Asset Securitization Trust, Series 2006-A8, Class 3A4	6.00%	08/25/2036		133		77,604	0.0
						639,427	0.1
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH							
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2005-8, Class 2A2(a) (c)	4.63%	09/25/2035		150		5,973	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust, Series 2007-FA2, Class 1A6(a) (c)	5.38%	04/25/2037		75		12,498	0.0
Impac Secured Assets Corp., Series 2005-2, Class A2D(a)	0.60%	03/25/2036		205		82,268	0.0
Lehman XS Trust, Series 2007-10H, Class 2AIO(a) (c)	6.63%	07/25/2037		168		26,443	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust, Series 2006-QS18, Class 2A2(a) (c)	6.38%	12/25/2036		2,468		364,447	0.1
						491,629	0.1
VARIABEL VERZINSLICHE STAATSPAPIERE							
Federal National Mortgage Association REMICs, Series 3067, Class FA(a)	0.53%	11/15/2035		218		176,036	0.0
						66,040,583	7.6
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT							
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
WEPA Hygieneprodukte GmbH	2.88%	12/15/2027	EUR	1,765		1,575,618	0.2
INVESTITIONSGÜTER							
Colfax Corp.	3.25%	05/15/2025		2,205		1,964,930	0.2
Crown European Holdings SA	2.63%	09/30/2024		2,090		1,888,211	0.2
Silgan Holdings, Inc.	2.25%	06/01/2028		1,009		886,510	0.1
Trivium Packaging Finance BV	5.50%	08/15/2026	USD	325		276,186	0.1
						5,015,837	0.6
KOMMUNIKATIONSMEDIEN							
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	08/01/2022		1,335		1,083,564	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ							
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023		1,547		1,299,987	0.1
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025		571		485,580	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(d)	3.63%	05/15/2025	EUR	1,751		1,536,591	0.2
						3,322,158	0.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (GBP)	Nettover-mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG						
CPUK Finance Ltd.	4.25%	08/28/2022	GBP	1,371	£ 1,245,045	0.1%
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
Dufry One BV	2.00%	02/15/2027	EUR	206	151,488	0.0
Dufry One BV	2.50%	10/15/2024		1,105	859,120	0.1
Marks & Spencer PLC	3.25%	07/10/2027	GBP	640	592,058	0.1
					1,602,666	0.2
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	3.50%	02/15/2023	USD	1,294	1,051,500	0.1
Catalent Pharma Solutions, Inc.	2.38%	03/01/2028	EUR	1,419	1,208,542	0.2
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027		465	411,476	0.1
Grifols SA	1.63%	02/15/2025		2,180	1,923,842	0.2
IQVIA, Inc.	3.50%	10/15/2024		2,165	1,969,981	0.2
					6,565,341	0.8
ENERGIE						
Occidental Petroleum Corp.	3.50%	08/15/2029	USD	1,885	1,037,125	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	4.88%	01/15/2023		827	680,455	0.1
Western Midstream Operating LP	3.10%	02/01/2025		2,425	1,825,652	0.2
					3,543,232	0.4
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	EUR	442	379,272	0.0
Rexel SA	2.63%	06/15/2024		2,240	1,999,454	0.2
SPIE SA	3.13%	03/22/2024		2,200	1,958,150	0.2
Travis Perkins PLC	4.38%	09/15/2021	GBP	1,320	1,269,640	0.2
					5,606,516	0.6
DIENSTLEISTUNGEN						
Arena Luxembourg Finance SARL	1.88%	02/01/2028	EUR	1,300	1,059,535	0.2
Intertrust Group BV	3.38%	11/15/2025		2,085	1,872,031	0.2
Q-Park Holding I BV	2.00%	03/01/2027		1,215	1,032,516	0.1
					3,964,082	0.5
TECHNOLOGIE						
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024	USD	1,164	968,010	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	7.13%	06/15/2024		1,330	1,118,704	0.1
					2,086,714	0.2
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Europcar Mobility Group	4.13%	11/15/2024	EUR	1,171	676,464	0.1
Loxam SAS	3.25%	01/14/2025		870	713,924	0.1
Loxam SAS	4.25%	04/15/2024		1,270	1,077,115	0.1
					2,467,503	0.3
					38,078,276	4.4
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Allied Irish Banks PLC, Series E(b)	7.38%	12/03/2020		815	732,543	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(b)	8.88%	04/14/2021		2,800	2,617,580	0.3
Banco Santander SA(b)	6.75%	04/25/2022		1,600	1,466,191	0.1
Bank of Ireland(b)	7.38%	06/18/2020		570	514,039	0.1
Credit Suisse Group AG(b)	7.50%	12/11/2023	USD	2,187	1,908,091	0.2
					7,238,444	0.8
FINANZEN						
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR	2,131	1,741,146	0.2
Navient Corp.	6.63%	07/26/2021	USD	2,035	1,626,044	0.2
					3,367,190	0.4
SONSTIGE FINANZWERTE						
Intrum AB	3.50%	07/15/2026	EUR	1,730	1,330,979	0.2
REITS						
Iron Mountain, Inc.	3.00%	01/15/2025		2,226	1,902,933	0.2
					13,839,546	1.6
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
Orano SA	3.38%	04/23/2026		1,700	1,542,839	0.2
					53,460,661	6.2
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN						
CHILE						
Chile Government International Bond	1.63%	01/30/2025		1,257	1,181,372	0.1
FRANKREICH						
Dexia Credit Local SA	1.13%	06/15/2022	GBP	7,800	7,906,922	0.9

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (GBP)	Nettover-mögen %
DEUTSCHLAND							
	Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	4.00%	02/27/2025	AUD	25,320	£ 15,652,605	1.8%
	Landwirtschaftliche Rentenbank	4.25%	01/09/2025		25,640	15,954,490	1.8
						31,607,095	3.6
INDONESIEN							
	Indonesia Government International Bond	3.38%	07/30/2025	EUR	3,090	2,978,731	0.3
PERU							
	Peruvian Government International Bond	2.39%	01/23/2026	USD	2,318	1,939,800	0.2
PHILIPPINEN							
	Philippine Government International Bond	0.00%	02/03/2023	EUR	2,480	2,163,609	0.3
KATAR							
	Qatar Government International Bond	3.40%	04/16/2025	USD	440	380,992	0.1
SAUDI-ARABIEN							
	Saudi Government International Bond	3.25%	10/26/2026		2,821	2,416,124	0.3
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE							
	Abu Dhabi Government International Bond	2.50%	04/16/2025		876	738,571	0.1
						51,313,216	5.9
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE							
JAPAN							
	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 20	0.10%	03/10/2025	JPY	24,356	182,865	0.0
	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 21	0.10%	03/10/2026		315,503	2,371,219	0.3
	Japanese Government CPI Linked Bond, Series 23	0.10%	03/10/2028		5,970	44,804	0.0
						2,598,888	0.3
VEREINIGTE STAATEN							
	U.S. Treasury Inflation Index(e)	0.63%	01/15/2024	USD	20,200	16,948,936	2.0
	U.S. Treasury Inflation Index(e)	0.63%	01/15/2026		23,654	20,348,339	2.3
	U.S. Treasury Inflation Index	2.38%	01/15/2025		1,869	1,711,903	0.2
						39,009,178	4.5
						41,608,066	4.8
GEDECKTE ANLEIHEN							
	Australia & New Zealand Banking Group Ltd.(a)	0.75%	01/24/2022	GBP	2,210	2,214,641	0.2
	Bank of Nova Scotia (The)(a)	0.90%	01/10/2023		4,000	3,966,699	0.5
	Canadian Imperial Bank of Commerce(a)	1.10%	01/10/2022		4,155	4,152,866	0.5
	Korea Housing Finance Corp.	2.00%	10/11/2021	USD	2,555	2,089,245	0.2
	Nationwide Building Society(a)	0.48%	04/12/2023	GBP	2,230	2,226,903	0.2
	Royal Bank of Canada(a)	0.70%	12/08/2022		1,400	1,389,213	0.2
	Toronto-Dominion Bank (The), Series G(a)	0.81%	01/30/2023		4,000	3,965,483	0.5
	Turkiye Vakiflar Bankasi TAO	2.38%	05/04/2021	EUR	2,157	1,910,946	0.2
						21,915,996	2.5
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN							
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS							
	AB SICAV I - China Bond - Class SA				1,842,374	21,714,086	2.5
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN							
	European Investment Bank	4.75%	08/07/2024	AUD	12,490	7,835,403	0.9
	International Finance Corp.	4.00%	04/03/2025		19,050	11,810,448	1.4
						19,645,851	2.3
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE							
QUASI-STAATSANLEIHEN							
CHILE							
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.15%	01/14/2030	USD	2,435	2,037,587	0.3
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031		206	178,478	0.0
	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	3.65%	05/07/2030		247	213,850	0.0
						2,429,915	0.3
CHINA							
	Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd.	2.15%	05/13/2025		1,704	1,400,697	0.2
	State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	1.25%	05/19/2022	EUR	2,155	1,953,919	0.2
						3,354,616	0.4
INDONESIEN							
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	USD	722	608,555	0.1
MALAYSIA							
	Petronas Capital Ltd.	3.50%	04/21/2030		491	440,077	0.1
MEXIKO							
	Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027		2,745	1,962,897	0.2
SÜDKOREA							
	Export-Import Bank of Korea	3.70%	02/19/2021	AUD	1,560	858,139	0.1
	Korea Development Bank (The)(a)	1.91%	10/01/2022	USD	4,820	3,872,737	0.4
						4,730,876	0.5

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (GBP)	Nettover-mögen %
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
MDGH - GMTN BV	2.50%	11/07/2024	USD	2,373	£ 1,957,677	0.2%
					15,484,613	1.8
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE						
KENIA						
Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024		2,420	1,880,521	0.2
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominican Republic International Bond	5.88%	04/18/2024		1,395	1,139,792	0.1
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027		885	695,773	0.1
					1,835,565	0.2
SENEGAL						
Senegal Government International Bond	6.25%	07/30/2024		1,000	806,680	0.1
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033		1,216	920,000	0.1
					1,726,680	0.2
ÄGYPTEN						
Egypt Government International Bond	4.75%	04/16/2026	EUR	1,215	1,025,184	0.1
Egypt Government International Bond	5.75%	05/29/2024	USD	845	684,638	0.1
					1,709,822	0.2
BAHRAIN						
Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031		1,790	1,366,958	0.2
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030		206	175,976	0.0
					1,542,934	0.2
NIGERIA						
Nigeria Government International Bond	5.63%	06/27/2022		970	768,980	0.1
Nigeria Government International Bond	6.75%	01/28/2021		930	752,331	0.1
					1,521,311	0.2
SÜDAFRIKA						
Republic of South Africa Government International Bond	4.30%	10/12/2028		1,485	1,079,556	0.1
HONDURAS						
Honduras Government International Bond	8.75%	12/16/2020		491	400,801	0.1
SRI LANKA						
Sri Lanka Government International Bond	6.85%	03/14/2024		471	215,597	0.0
					11,912,787	1.4
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN						
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS						
Commercial Mortgage Trust, Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047		2,000	1,651,776	0.2
GS Mortgage Securities Trust						
Series 2010-C1, Class A2	4.59%	08/10/2043		29	23,699	0.0
Series 2011-GC5, Class D	5.39%	08/10/2044		500	293,130	0.0
Series 2013-G1, Class A1	2.06%	04/10/2031		291	236,424	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust,						
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047		868	679,951	0.1
LSTAR Commercial Mortgage Trust, Series 2016-4, Class A2	2.58%	03/10/2049		1,146	941,457	0.1
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust,						
Series 2013-C9, Class D	4.12%	05/15/2046		280	174,418	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2011-C1, Class D	5.50%	09/15/2047		800	640,092	0.1
					4,640,947	0.5
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS						
BX Trust, Series 2018-EXCL, Class A(a)	1.27%	09/15/2037		2,405	1,709,495	0.2
					6,350,442	0.7
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN						
KANADA						
Province of Alberta Canada	1.00%	11/15/2021	GBP	3,635	3,664,985	0.4
Province of Quebec Canada	4.20%	03/10/2025	AUD	4,000	2,466,008	0.3
					6,130,993	0.7
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS						
CLO – VARIABEL VERZINSLICH						
Golub Capital Partners 48 LP Series 2020-48A, Class A1 (a)				1,720,000	1,323,950	0.1
SCFF I Ltd. Series 2020-1A, Class A1 (a)				2,869,000	2,341,357	0.3
OCP CLO Ltd. Series 2020-18A, Class A (a)				2,832,046	2,293,155	0.3
					5,958,462	0.7
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
Republic of South Africa Government Bond Series 2030				103,185,357	4,483,226	0.5
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Minerva Luxembourg SA.	6.50%	09/20/2026	USD	523	425,599	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (GBP)	Nettover-mögen %
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Rumo Luxembourg SARL	7.38%	02/09/2024	USD	988	£ 836,500	0.1%
					1,262,099	0.1
ABS-ANLEIHEN						
BAUSPARDARLEHEN – FESTVERZINSLICH						
Credit-Based Asset Servicing & Securitization LLC, Series 2003-CB1, Class AF	3.95%	01/25/2033		44	35,936	0.0
GSAA Home Equity Trust, Series 2006-6, Class AF4	6.12%	03/25/2036		491	167,879	0.0
					203,815	0.0
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN						
OPTIONEN AUF TERMINKONTRAKTE						
CNH/USD1 Expiration: Jun 2020, Exercise Price: CNH 7.30(f)				66,539,500	1,714	0.0
CNH/USD2 Expiration: Jun 2020, Exercise Price: CNH 7.30(f)				57,034,900	1,469	0.0
CNH/USD2 Expiration: Jun 2020, Exercise Price: CNH 7.30(f)				57,034,900	1,469	0.0
CNH/USD2 Expiration: Jun 2020, Exercise Price: CNH 7.30(f)				180,886,700	4,658	0.0
					9,310	0.0
					793,452,690	91.4
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
United Kingdom Treasury Bill	0.00%	11/09/2020	GBP	12,200	12,191,538	1.4
United Kingdom Treasury Bill	0.00%	11/23/2020		10,465	10,459,046	1.2
					22,650,584	2.6
					816,103,274	94.0
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN						
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH						
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-3R, Class A(a)	2.87%	10/27/2022	USD	328	212,499	0.0
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN						
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS						
DBUBS Mortgage Trust, Series 2011-LC2A, Class D	5.53%	07/10/2044		1,149	752,258	0.1
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-C8, Class B	3.98%	10/15/2045		1,050	832,448	0.1
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2014-C16, Class D	4.77%	06/15/2047		4,190	2,350,863	0.3
					3,935,569	0.5
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS						
BHMS, Series 2018-ATLS, Class A(a)	1.43%	07/15/2035		2,018	1,520,719	0.1
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2015-XLF2, Class SNMD(a)	1.92%	11/15/2026		1,100	572,905	0.1
					2,093,624	0.2
					6,029,193	0.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
AbbVie, Inc.	1.25%	06/01/2024	EUR	2,455	2,241,093	0.3
ENERGIE						
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	USD	1,500	1,222,265	0.1
TECHNOLOGIE						
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028		2,242	1,901,183	0.2
Fiserv, Inc.	1.13%	07/01/2027	EUR	1,236	1,115,226	0.1
					3,016,409	0.3
					6,479,767	0.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
OCI NV	5.00%	04/15/2023		2,145	1,956,268	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	4.38%	05/15/2026		925	806,923	0.1
ENERGIE						
Occidental Petroleum Corp.(a)	1.84%	08/15/2022	USD	3,253	2,298,823	0.3
Targa Resources Partners LP/ Targa Resources Partners Finance Corp.	6.50%	07/15/2027		1,820	1,541,604	0.2
					3,840,427	0.5
					6,603,618	0.8

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover-mögen %
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	USD 936	£ 652,547	0.1%
Odebrecht Finance Ltd.(g)	7.13%	06/26/2042	1,700	23,229	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(h)	10.50%	01/28/2018	1,371	9,431	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(g)	11.75%	02/09/2022	499	3,797	0.0
				689,004	0.1
				20,014,081	2.3
Gesamtanlagen					
(Kosten £820,106,933)				£836,117,355	96.3%
Termineinlagen					
ANZ, London(i)	0.01 %	–		14,610,595	1.7
Bank of Nova Scotia, Toronto(i)	0.04 %	–		687,598	0.1
BBH, Grand Cayman(i)	(0.25)%	–		3	0.0
BBH, Grand Cayman(i)	0.01 %	–		30	0.0
BBH, Grand Cayman(i)	2.75 %	–		146	0.0
MUFG, Tokyo(i)	(0.26)%	–		1,177,935	0.1
National Australia Bank, London(i)	0.01 %	–		1,055,022	0.1
Sumitomo, Tokyo(i)	(0.67)%	–		2,051,226	0.2
Sumitomo, London(i)	0.01 %	–		22,428,512	2.6
Termineinlagen insgesamt				42,011,067	4.8
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(9,809,241)	(1.1)
Nettovermögen				£868,319,181	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
10 Yr Canadian Bond Futures	09/21/2020	104	£ 9,428,745	£ 9,396,888	£ (31,857)
U.S. 10 Yr Ultra Futures	09/21/2020	113	14,323,279	14,395,205	71,926
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2020	80	14,187,506	14,123,482	(64,025)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2020	192	21,575,778	21,619,433	43,655
Short					
10 Yr Australian Bond Futures	06/15/2020	242	19,518,774	19,457,096	61,678
10 Yr Japan Bond (OSE) Futures	06/15/2020	3	3,483,294	3,428,223	55,072
10 Yr Mini Japan Government Bond Futures	06/12/2020	1	116,159	114,267	1,892
Euro-BOBL Futures	06/08/2020	317	38,815,454	38,507,992	307,461
Euro-Bund Futures	06/08/2020	169	26,541,690	26,196,945	344,745
Euro-Schatz Futures	06/08/2020	210	21,223,436	21,150,766	72,670
Long Gilt Futures	09/28/2020	40	5,494,800	5,497,600	(2,800)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	254	45,412,462	45,420,496	(8,034)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	875	88,894,863	89,005,567	(110,703)
					£ 741,680
				Wertsteigerung	£ 959,099
				Wertminderung	£ (217,419)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	AUD	2,467	GBP	1,295	06/11/2020	£ (36,465)
Bank of America, NA.	EUR	14,806	GBP	12,954	06/10/2020	(355,601)
Bank of America, NA.	MXN	421,001	GBP	13,924	06/19/2020	(1,408,509)
Bank of America, NA.	USD	2,541	GBP	2,063	07/17/2020	6,612
Bank of America, NA.	USD	16,879	GBP	13,783	07/23/2020	118,284
Bank of America, NA.	USD	18,984	RUB	1,383,380	07/14/2020	426,322
Bank of America, NA.	USD	76,146	GBP	62,282	07/15/2020	636,669
Bank of America, NA.	ZAR	20,484	GBP	904	07/17/2020	(36,799)
Barclays Bank PLC	EUR	3,683	GBP	3,258	06/10/2020	(52,908)
Barclays Bank PLC	INR	94,075	USD	1,204	07/23/2020	(28,641)
Barclays Bank PLC	USD	9,155	TWD	268,910	08/20/2020	(107,189)
Barclays Bank PLC	USD	8,455	KRW	10,411,446	08/13/2020	(6,247)
Barclays Bank PLC	USD	2,619	INR	205,555	07/23/2020	71,510
Barclays Bank PLC	USD	12,486	NZD	20,867	06/04/2020	378,382
BNP Paribas SA	AUD	13,213	USD	8,114	06/11/2020	(561,603)
BNP Paribas SA	BRL	53,731	USD	9,992	06/02/2020	(62,614)
BNP Paribas SA	CAD	12,987	USD	9,314	08/06/2020	(95,760)
BNP Paribas SA	USD	1,685	GBP	1,377	07/17/2020	12,742
BNP Paribas SA	USD	9,976	BRL	53,731	07/02/2020	62,255
BNP Paribas SA	USD	7,895	IDR	118,067,348	07/23/2020	69,511

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
BNP Paribas SA	USD	9,620	AUD	14,599	06/11/2020	£ 90,035
Brown Brothers Harriman & Co.	CNH	38,121	GBP	4,369	06/16/2020	49,254
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	10,266	GBP	9,028	06/10/2020	(200,971)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	1,758	USD	2,163	07/17/2020	(7,032)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	35,476	GBP	1,167	06/19/2020	(125,057)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	10,200	GBP	8,329	07/17/2020	71,548
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	61,438	GBP	50,575	06/05/2020	828,200
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	11,554	GBP	537	07/17/2020	6,439
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	1,517	CHF	1,814	06/12/2020	11,141
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	27,811	EUR	31,613	06/12/2020	607,972
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	11,626	SGD	20,295	06/12/2020	5,560
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	19	USD	24	06/12/2020	(45)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	1,490	CHF	1,774	06/30/2020	4,058
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	25,309	EUR	28,232	06/30/2020	78,064
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	11,571	SGD	20,157	06/30/2020	(18,824)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	18	USD	22	06/30/2020	(102)
Citibank, NA	AUD	12,101	GBP	6,404	06/11/2020	(126,983)
Citibank, NA	BRL	53,698	USD	10,098	07/02/2020	41,449
Citibank, NA	CLP	15,247,432	USD	18,539	07/15/2020	(413,716)
Citibank, NA	COP	37,335,002	USD	9,362	07/15/2020	(492,246)
Citibank, NA	EUR	10,178	GBP	8,921	06/10/2020	(228,827)
Citibank, NA	EUR	3,631	USD	3,943	06/10/2020	(71,446)
Citibank, NA	GBP	4,434	JPY	579,629	06/05/2020	(82,200)
Citibank, NA	GBP	6,230	AUD	11,824	06/11/2020	151,372
Citibank, NA	JPY	474,973	USD	4,443	06/05/2020	31,285
Citibank, NA	KRW	787,816	USD	644	08/13/2020	3,955
Citibank, NA	MXN	231,397	USD	9,913	06/19/2020	(401,081)
Citibank, NA	SEK	85,637	GBP	7,098	07/15/2020	(262,344)
Citibank, NA	USD	2,928	GBP	2,389	07/17/2020	17,816
Citibank, NA	USD	9,890	COP	37,163,214	07/15/2020	28,169
Citibank, NA	USD	14,950	EUR	13,588	06/10/2020	109,354
Citibank, NA	USD	18,490	NOK	181,141	07/15/2020	121,957
Credit Suisse International	NOK	89,162	USD	8,728	07/15/2020	(362,169)
Credit Suisse International	NZD	13,696	USD	8,403	06/04/2020	(79,559)
Credit Suisse International	SGD	27,124	USD	19,107	08/27/2020	(80,259)
Credit Suisse International	USD	15,754	PLN	63,584	07/29/2020	77,862
Credit Suisse International	USD	27,833	MXN	689,161	06/19/2020	2,562,777
Deutsche Bank AG	EUR	37,541	GBP	33,055	07/09/2020	(707,644)
Deutsche Bank AG	EUR	37,541	GBP	33,080	08/13/2020	(705,293)
Goldman Sachs Bank USA	KRW	26,726,278	USD	21,812	08/13/2020	103,573
Goldman Sachs Bank USA	MYR	41,053	USD	9,998	08/13/2020	462,264
Goldman Sachs Bank USA	NZD	15,253	GBP	7,514	06/04/2020	(152,510)
Goldman Sachs Bank USA	USD	2,226	MYR	9,226	08/13/2020	(86,992)
HSBC Bank USA	GBP	15,641	SGD	27,123	08/27/2020	(95,839)
HSBC Bank USA	PLN	63,621	GBP	12,416	07/29/2020	(423,394)
HSBC Bank USA	USD	76,146	GBP	62,293	06/04/2020	637,206
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	3,063	GBP	2,686	06/10/2020	(67,099)
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	7,286	CHF	8,638	08/28/2020	2,484
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	3,635	AUD	7,269	06/11/2020	288,252
JPMorgan Chase Bank, NA	NOK	91,944	GBP	7,343	07/15/2020	(317,010)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	9,942	GBP	8,094	07/23/2020	46,335
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	4,251	NZD	7,129	06/04/2020	141,107
Morgan Stanley & Co. LLC	CAD	7,564	GBP	4,445	08/06/2020	(2,062)
Morgan Stanley & Co. LLC	EUR	9,789	GBP	8,634	06/10/2020	(166,307)
Morgan Stanley & Co. LLC	IDR	72,446,228	USD	4,526	07/23/2020	(299,930)
Morgan Stanley & Co. LLC	JPY	1,035,772	USD	9,622	06/05/2020	13,915
Morgan Stanley & Co. LLC	USD	7,664	MYR	31,827	08/13/2020	(287,727)
Morgan Stanley & Co. LLC	USD	3,782	GBP	3,083	07/17/2020	20,950
Morgan Stanley & Co. LLC	USD	4,718	RUB	352,337	07/14/2020	203,221
Morgan Stanley & Co. LLC	USD	61,438	GBP	50,397	06/10/2020	650,745
Morgan Stanley & Co. LLC	ZAR	46,683	USD	2,536	07/17/2020	(89,718)
Royal Bank of Scotland PLC	AUD	114,459	GBP	57,542	06/11/2020	(4,232,707)
Royal Bank of Scotland PLC	CNH	26,155	GBP	2,977	06/01/2020	9,835
Royal Bank of Scotland PLC	CNH	193,570	GBP	22,036	06/16/2020	99,671
Royal Bank of Scotland PLC	EUR	5,272	GBP	4,621	06/10/2020	(118,268)
Royal Bank of Scotland PLC	GBP	2,974	CNH	26,155	06/16/2020	(10,231)
Royal Bank of Scotland PLC	GBP	1,469	JPY	197,475	06/05/2020	14,149
Royal Bank of Scotland PLC	NZD	9,781	USD	5,895	06/04/2020	(143,409)
Societe Generale	EUR	1,605	GBP	1,401	06/10/2020	(41,621)
Societe Generale	USD	76,146	GBP	62,281	08/13/2020	643,050
Standard Chartered Bank	GBP	1,715	JPY	229,811	06/05/2020	10,359
Standard Chartered Bank	IDR	58,372,812	USD	3,618	07/23/2020	(265,198)
Standard Chartered Bank	INR	198,804	USD	2,618	07/23/2020	(447)
Standard Chartered Bank	USD	9,378	TWD	276,190	08/20/2020	(89,652)
Standard Chartered Bank	USD	9,615	BRL	53,731	06/02/2020	367,164

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
State Street Bank & Trust Co.	USD	14,211	GBP	11,714	06/11/2020	£ 207,788
UBS AG	AUD	18,310	GBP	9,356	06/11/2020	(525,801)
UBS AG	EUR	47,835	GBP	42,347	06/30/2020	(667,135)
UBS AG	EUR	47,438	GBP	42,556	07/30/2020	(125,768)
UBS AG	EUR	1,578	GBP	1,376	06/10/2020	(42,099)
						£ (4,766,436)
					Wertsteigerung	£ 10,602,622
					Wertminderung	£ (15,369,058)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)		Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Conagra Brands, Inc.	06/20/2024	USD	3,700	£ (86,038)	£ (59,158)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal-betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	CAD 15,000	01/14/2050	2.210%	3 Month CDOR	£ (1,784,346)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	70,799	01/14/2025	3 Month CDOR	1.950%	2,328,461
Insgesamt					£ 544,115
				Wertsteigerung	£ 2,328,461
				Wertminderung	£ (1,784,346)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)		Markt-wert	Vorab-gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte							
Barclays Bank PLC	Deutsche Telekom AG	12/20/2023	EUR	3,400	£ (79,492)	£ (48,842)	£ (30,650)
Credit Suisse International	Safeway Ltd.	12/20/2020		1,920	(8,657)	3,917	(12,574)
JPMorgan Chase Bank, NA	Kingfisher PLC	12/20/2020		1,860	(6,353)	(2,670)	(3,683)
JPMorgan Chase Bank, NA	Campbell Soup Co.	12/20/2023	USD	4,020	(93,994)	37,591	(131,585)
Verkaufskontrakte							
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		1,000	(270,850)	(82,496)	(188,354)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		3,000	(812,551)	(258,939)	(553,612)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		2,700	(731,296)	(233,533)	(497,763)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		3,020	(817,968)	(142,234)	(675,734)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063		13,570	(1,802,008)	(181,294)	(1,620,714)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063		870	(115,530)	(24,171)	(91,359)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		1,368	(370,523)	(67,893)	(302,630)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		2,742	(742,671)	(271,953)	(470,718)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		7,130	(1,931,162)	(472,005)	(1,459,157)
Insgesamt					£ (7,783,055)	£ (1,744,522)	£ (6,038,533)
Swaps insgesamt							£ (5,553,576)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2020.

(b) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.

(c) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.

(d) Zahlungen in Sachwerten (PIK). Der Emittent kann Zinsen in bar und/oder in zusätzlichen Schuldtiteln auszahlen. Die angegebenen Zinssätze sind die am 31. Mai 2020 geltenden Zinssätze.

(e) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für Derivate zu dienen.

(f) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.

(g) Not leidend.

(h) Not leidendes fälliges Wertpapier.

(i) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
BRL – Brazilian Real
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
IDR – Indonesian Rupiah
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
TWD – New Taiwan Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

BOBL – Bundesobligationen
CBT – Chicago Board of Trade
CDOR – Canadian Dealer Offered Rate
CDX-CMBX.NA – North American Commercial Mortgage-Backed Index
CLO – Collateralized Loan Obligations
CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
CPI – Consumer Price Index
GMTN – Global Medium Term Note
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
LCH – London Clearing House
OSE – Osaka Securities Exchange
PJSC – Public Joint Stock Company
REG – Registered Shares
REMICs – Real Estate Mortgage Investment Conduits

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIEN					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN					
Amphenol Corp. - Class A			451,125	$ 43,560,630	4.8%
CDW Corp./DE			329,626	36,558,820	4.1
				80,119,450	8.9
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
Automatic Data Processing, Inc.			217,889	31,918,560	3.5
Mastercard, Inc. - Class A			258,341	77,732,223	8.7
				109,650,783	12.2
SOFTWARE					
Microsoft Corp.			419,593	76,890,417	8.6
				266,660,650	29.7
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF					
Abbott Laboratories			705,703	66,985,329	7.5
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN					
IQVIA Holdings, Inc.			489,632	73,209,777	8.1
PHARMAZEUTIKA					
Zoetis, Inc.			315,513	43,979,357	4.9
				184,174,463	20.5
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
Aptiv PLC			482,466	36,353,813	4.0
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL					
TJX Cos., Inc. (The)			836,782	44,148,618	4.9
Ulta Beauty, Inc.			120,229	29,337,078	3.3
				73,485,696	8.2
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER					
NIKE, Inc. - Class B			407,177	40,139,509	4.5
				149,979,018	16.7
INDUSTRIEGÜTER					
BAUPRODUKTE					
Allegion PLC			342,863	34,183,441	3.8
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF					
Stericycle, Inc.			784,288	43,002,511	4.8
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN					
Verisk Analytics, Inc. - Class A			240,202	41,478,082	4.6
				118,664,034	13.2
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Alphabet, Inc. - Class C			27,328	39,049,526	4.4
Facebook, Inc. - Class A			181,156	40,776,404	4.5
				79,825,930	8.9
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
International Flavors & Fragrances, Inc.			320,023	42,623,863	4.8
FINANZWERTE					
KAPITALMÄRKTE					
Charles Schwab Corp. (The)			1,140,332	40,949,322	4.6
Gesamtanlagen					
(Kosten $717,564,076)				$ 882,877,280	98.4%
Termineinlagen					
Barclays, London(a)	0.01 %	–		13,499,526	1.6
BBH, Grand Cayman(a)	0.01 %	–		3	0.0
Termineinlagen insgesamt				13,499,529	1.6
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				409,481	0.0
Nettovermögen				$ 896,786,290	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,411	AUD	3,716	06/12/2020	$ 66,282
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,911	CHF	1,855	06/12/2020	18,027
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	60,496	EUR	55,713	06/12/2020	1,359,739
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	12,218	GBP	9,916	06/12/2020	27,889
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	7,476	SGD	10,591	06/12/2020	20,629
						$ 1,492,566

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CHF – Swiss Franc
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Amphenol Corp. - Class A	179,621	$ 17,344,204	2.8%
Keyence Corp.	45,800	18,864,982	3.1
Murata Manufacturing Co., Ltd.	267,800	15,063,159	2.4
		51,272,345	8.3
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Automatic Data Processing, Inc.	94,255	13,807,415	2.2
Capgemini SE	163,562	16,895,068	2.7
Mastercard, Inc. - Class A	110,863	33,357,568	5.4
		64,060,051	10.3
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV	73,989	24,237,295	3.9
SOFTWARE			
Microsoft Corp.	216,821	39,732,448	6.4
Temenos AG (a)	98,159	15,087,433	2.4
		54,819,881	8.8
		194,389,572	31.3
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Genmab A/S	78,352	24,259,960	3.9
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	256,067	24,305,880	3.9
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Eurofins Scientific SE (a)	35,641	24,232,100	3.9
IQVIA Holdings, Inc.	128,518	19,216,011	3.1
		43,448,111	7.0
PHARMAZEUTIKA			
Zoetis, Inc.	173,365	24,165,347	3.9
		116,179,298	18.7
INDUSTRIEGÜTER			
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Stericycle, Inc.	321,794	17,643,965	2.8
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Nidec Corp.	207,000	12,742,232	2.1
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Recruit Holdings Co., Ltd.	462,700	15,938,601	2.6
Verisk Analytics, Inc. - Class A	161,161	27,829,281	4.5
		43,767,882	7.1
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Ashtead Group PLC	480,767	14,356,797	2.3
		88,510,876	14.3
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	168,306	12,681,857	2.0
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Compass Group PLC	871,512	12,775,843	2.1
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	102,049	21,163,942	3.4
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Ulta Beauty, Inc. (a)	57,327	13,988,362	2.3
		60,610,004	9.8
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
Walt Disney Co. (The)	111,623	13,093,378	2.1
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Facebook, Inc. - Class A	91,757	20,653,583	3.3
Tencent Holdings Ltd.	382,700	20,725,451	3.4
		41,379,034	6.7
		54,472,412	8.8
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Treasury Wine Estates Ltd.	2,126,203	13,670,389	2.2

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Nestle SA (REG)			216,313	$ 23,486,628	3.8%
				37,157,017	6.0
FINANZWERTE					
KAPITALMÄRKTE					
Charles Schwab Corp. (The)			506,273	18,180,263	2.9
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
International Flavors & Fragrances, Inc.			119,103	15,863,329	2.6
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
American Tower Corp.			49,803	12,857,640	2.1
Gesamtanlagen					
(Kosten $529,877,654)				$ 598,220,411	96.5%
Termineinlagen					
Barclays, London(b)	0.01 %	–		1,499,716	0.2
BBH, Grand Cayman(b)	(0.60)%	–		4,631,629	0.7
BBH, Grand Cayman(b)	0.01 %	–		1	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.03 %	–		52,150	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.39)%	–		2,849,517	0.5
Deutsche Bank, Frankfurt(b)	(0.67)%	–		72,640	0.0
National Australia Bank, London(b)	0.01 %	–		58,656	0.0
Sumitomo, London(b)	(0.26)%	–		48,571	0.0
Termineinlagen insgesamt				9,212,880	1.4
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				12,772,095	2.1
Nettovermögen				$ 620,205,386	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC	CHF	1,365	USD	1,442	06/15/2020	$ 22,499
Barclays Bank PLC	CNH	70,415	USD	9,969	06/15/2020	112,863
Barclays Bank PLC	EUR	4,790	USD	5,250	06/15/2020	(68,634)
Barclays Bank PLC	GBP	2,059	USD	2,519	06/15/2020	(24,026)
Barclays Bank PLC	JPY	160,946	USD	1,511	06/15/2020	18,263
Barclays Bank PLC	USD	1,495	CAD	2,108	06/15/2020	35,975
Barclays Bank PLC	USD	1,438	CAD	1,911	06/15/2020	(50,389)
Barclays Bank PLC	USD	5,339	CNH	38,100	06/15/2020	(5,582)
Barclays Bank PLC	USD	817	EUR	751	06/15/2020	17,086
Barclays Bank PLC	CHF	1,934	USD	2,005	09/14/2020	(11,953)
Barclays Bank PLC	JPY	168,510	USD	1,579	09/14/2020	14,299
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	59	CAD	82	06/15/2020	212
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	116	CAD	162	06/12/2020	1,827
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	263	CHF	256	06/12/2020	2,576
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,535	EUR	3,260	06/12/2020	84,142
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,160	GBP	941	06/12/2020	2,867
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	47	SGD	66	06/12/2020	130
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	45	SGD	64	06/30/2020	183
Citibank, NA	CHF	2,900	USD	3,040	06/15/2020	23,620
Citibank, NA	CNH	8,399	USD	1,184	06/15/2020	8,444
Citibank, NA	EUR	7,536	USD	8,249	06/15/2020	(118,365)
Citibank, NA	EUR	6,303	USD	7,035	06/15/2020	36,642
Citibank, NA	USD	11,648	CAD	16,117	06/15/2020	58,017
Citibank, NA	USD	2,909	CHF	2,738	06/15/2020	(60,801)
Citibank, NA	USD	2,424	EUR	2,204	06/15/2020	23,049
Citibank, NA	USD	4,287	JPY	467,869	06/15/2020	51,708
Citibank, NA	USD	4,116	JPY	430,393	06/15/2020	(124,392)
Citibank, NA	EUR	2,385	USD	2,587	09/14/2020	(66,337)
HSBC Bank USA	CNH	75,386	USD	10,716	06/15/2020	163,468
HSBC Bank USA	JPY	265,292	USD	2,447	06/15/2020	(12,836)
HSBC Bank USA	JPY	156,052	USD	1,457	06/15/2020	9,372
HSBC Bank USA	USD	4,967	EUR	4,430	06/15/2020	(47,810)
HSBC Bank USA	USD	1,805	CAD	2,532	09/14/2020	34,083
Morgan Stanley Capital Services LLC	CAD	1,821	USD	1,321	06/15/2020	(1,585)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	3,574	USD	3,847	06/15/2020	(121,579)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY	1,066,154	USD	10,168	06/15/2020	279,984
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,221	CAD	1,711	06/15/2020	21,537
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	750	EUR	654	06/15/2020	(24,252)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	4,015	GBP	3,230	06/15/2020	(25,385)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CHF	3,711	USD	3,852	09/14/2020	(18,388)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	1,909	USD	2,077	09/14/2020	$ (47,324)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	3,643	CAD	5,041	09/14/2020	18,413
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,523	GBP	1,236	09/14/2020	3,956
Standard Chartered Bank	JPY	316,913	USD	2,858	06/15/2020	(80,786)
Standard Chartered Bank	USD	5,054	CNH	35,906	06/15/2020	(28,284)
Standard Chartered Bank	USD	1,599	EUR	1,458	06/15/2020	19,797
Standard Chartered Bank	CNH	22,979	USD	3,217	09/14/2020	16,691
Standard Chartered Bank	CNY	17,180	USD	2,393	09/14/2020	(2,562)
Standard Chartered Bank	JPY	671,082	USD	6,239	09/14/2020	5,864
UBS AG	CAD	1,649	USD	1,169	06/15/2020	(29,101)
UBS AG	CHF	10,574	USD	11,223	06/15/2020	224,683
UBS AG	JPY	169,691	USD	1,603	06/15/2020	29,429
UBS AG	USD	1,908	CHF	1,794	06/15/2020	(41,904)
UBS AG	USD	1,268	EUR	1,172	06/15/2020	33,316
UBS AG	USD	1,808	JPY	194,531	06/15/2020	(3,897)
UBS AG	EUR	6,967	USD	7,622	09/14/2020	(128,827)
UBS AG	JPY	260,962	USD	2,428	09/14/2020	4,289
						$ 234,285
					Wertsteigerung	$ 1,379,284
					Wertminderung	$ (1,144,999)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY – Chinese Yuan Renminbi
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
JPY – Japanese Yen
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
REG – Registered Shares

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
IPG Photonics Corp.	48,838	$ 7,589,425	0.8%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Automatic Data Processing, Inc.	133,210	19,513,933	1.9
Cognizant Technology Solutions Corp. - Class A	570,616	30,242,648	2.9
Visa, Inc. - Class A	118,240	23,085,177	2.3
		72,841,758	7.1
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Xilinx, Inc.	119,321	10,971,566	1.1
SOFTWARE			
Microsoft Corp.	169,826	31,120,614	3.0
SAP SE	138,937	17,731,458	1.7
Trend Micro, Inc./Japan	420,707	23,156,664	2.3
VMware, Inc. - Class A	72,102	11,267,380	1.1
		83,276,116	8.1
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	551,375	22,708,976	2.2
		197,387,841	19.3
FINANZWERTE			
BANKEN			
DBS Group Holdings Ltd.	1,053,810	14,578,926	1.4
Jyske Bank A/S	486,270	13,427,833	1.3
Wells Fargo & Co.	554,083	14,666,577	1.5
		42,673,336	4.2
KAPITALMÄRKTE			
BlackRock, Inc. - Class A	12,874	6,805,711	0.7
CME Group, Inc. - Class A	42,612	7,780,951	0.7
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	29,810	5,857,367	0.6
Julius Baer Group Ltd.	648,546	27,912,148	2.7
Moody's Corp.	33,355	8,919,461	0.9
Singapore Exchange Ltd.	2,070,685	12,165,525	1.2
		69,441,163	6.8
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Berkshire Hathaway, Inc. - Class B	153,483	28,483,375	2.8
Pargesa Holding SA	115,237	8,751,656	0.8
		37,235,031	3.6
VERSICHERUNGEN			
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	6,940,765	6,072,655	0.6
		155,422,185	15.2
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Comcast Corp. - Class A	471,441	18,669,064	1.8
UNTERHALTUNG			
Nintendo Co., Ltd.	41,459	16,856,355	1.7
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	33,474	47,831,668	4.7
Facebook, Inc. - Class A	71,013	15,984,316	1.5
		63,815,984	6.2
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
China Mobile Ltd.	1,875,957	13,264,410	1.3
SoftBank Group Corp.	676,315	30,891,213	3.0
		44,155,623	4.3
		143,497,026	14.0
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Koninklijke Philips NV	644,456	29,298,881	2.9
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Anthem, Inc.	166,764	49,046,960	4.8
Henry Schein, Inc.	234,837	14,259,303	1.4
		63,306,263	6.2
PHARMAZEUTIKA			
Johnson & Johnson	114,434	17,022,058	1.7
Roche Holding AG	42,425	14,726,641	1.4
Sanofi	171,000	16,726,331	1.6
		48,475,030	4.7
		141,080,174	13.8

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
INDUSTRIEGÜTER					
BAUPRODUKTE					
Otis Worldwide Corp.			545,277	$ 28,708,834	2.8%
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF					
Secom Co., Ltd.			413,076	35,854,576	3.5
INDUSTRIEKONZERNE					
3M Co.			188,771	29,531,335	2.9
MASCHINEN					
Dover Corp.			149,543	14,543,057	1.4
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN					
RELX PLC			369,464	8,526,468	0.8
				117,164,270	11.4
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE					
Service Corp. International/US			710,167	28,001,885	2.7
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT					
Accor SA			227,037	6,418,308	0.6
Compass Group PLC			766,425	11,235,331	1.1
Starbucks Corp.			81,332	6,343,083	0.6
				23,996,722	2.3
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB					
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)			77,640	16,101,760	1.6
Naspers Ltd. - Class N			153,343	24,963,165	2.4
Prosus NV			168,332	13,939,527	1.4
				55,004,452	5.4
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER					
adidas AG			23,332	6,187,821	0.6
				113,190,880	11.0
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Asahi Group Holdings Ltd.			334,200	12,575,884	1.2
Coca-Cola Co. (The)			290,151	13,544,249	1.3
				26,120,133	2.5
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Danone SA			240,987	16,580,016	1.6
HAUSHALTSPRODUKTE					
Procter & Gamble Co. (The)			93,119	10,794,354	1.1
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE					
L'Oreal SA			40,924	12,003,480	1.2
				65,497,983	6.4
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
International Flavors & Fragrances, Inc.			317,400	42,274,506	4.1
PAPIER- UND HOLZPRODUKTE					
Mondi PLC			321,230	6,044,058	0.6
				48,318,564	4.7
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
LUKOIL PJSC (Sponsored ADR)			148,705	11,196,000	1.1
Marathon Petroleum Corp.			279,937	9,836,986	0.9
				21,032,986	2.0
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
CBRE Group, Inc. - Class A			326,665	14,366,727	1.4
Gesamtanlagen					
(Kosten $956,504,655)				$ 1,016,958,636	99.2%
Termineinlagen					
Barclays, London(a)	0.01%	_		2,660,945	0.3
BBH, Grand Cayman(a)	(0.60)%	_		16,489	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	0.01%	_		65,096	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	0.03%	_		98,552	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	2.75%	_		99,325	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(a)	(1.39)%	_		101,669	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(a)	(0.67)%	_		228,784	0.0
Sumitomo, London(a)	(0.26)%	_		156,092	0.0
Sumitomo, London(a)	0.01%	_		584,137	0.1

	Value (USD)	Net Assets %
Termineinlagen insgesamt	$ 4,011,089	0.4%
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten	3,975,477	0.4
Nettovermögen	$ 1,024,945,202	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	36,395	AUD	36,582	06/01/2020	$ 187,199
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10,037	EUR	10,044	06/01/2020	7,272
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	652	GBP	656	06/01/2020	3,467
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,653	HKD	3,653	06/01/2020	(67)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	220,005	JPY	220,028	06/01/2020	23,210
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,245	SGD	1,246	06/01/2020	1,613
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	8,963	ZAR	8,934	06/01/2020	(28,637)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,696	CHF	1,693	06/02/2020	(3,129)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,767	DKK	1,765	06/02/2020	(2,812)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	13,844	AUD	20,657	06/12/2020	347,568
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	12	CHF	12	06/12/2020	106
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	5,090	EUR	4,725	06/12/2020	111,045
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	17,676	GBP	14,589	06/12/2020	36,672
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	22,822	NOK	175,675	06/12/2020	818,448
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14	SGD	19	06/12/2020	34
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	13,838	AUD	20,910	06/30/2020	99,962
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	783	CHF	808	06/30/2020	(6,696)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,518	DKK	224	06/30/2020	(2,050)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	4,635	EUR	4,572	06/30/2020	5,815
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	245	GBP	302	06/30/2020	(1,678)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,498	HKD	322	06/30/2020	(73)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	209,158	JPY	1,939	06/30/2020	(1,042)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	714	SGD	531	06/30/2020	(1,825)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	7,699	ZAR	651	06/30/2020	4,066
						$ 1,598,468
					Wertsteigerung	$ 1,646,477
					Wertminderung	$ (48,009)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CHF – Swiss Franc
DKK – Danish Krone
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
HKD – Hong Kong Dollar
JPY – Japanese Yen
NOK – Norwegian Krone
SGD – Singapore Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
PJSC – Public Joint Stock Company

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE							
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT							
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
Advanced Drainage Systems, Inc.	5.00%	09/30/2027	USD	19	$	19,086	0.0%
Arconic Corp.	6.13%	02/15/2028		52		50,553	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043		3		3,171	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025		76		79,160	0.1
Constellium SE	4.25%	02/15/2026	EUR	160		165,715	0.1
Eldorado Gold Corp.	9.50%	06/01/2024	USD	185		195,909	0.2
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027		72		72,552	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.00%	09/01/2027		69		70,088	0.1
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027		46		48,175	0.1
Hecla Mining Co.	7.25%	02/15/2028		176		178,657	0.2
INEOS Group Holdings SA	5.38%	08/01/2024	EUR	155		172,958	0.2
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	11.00%	05/15/2022	USD	59		58,537	0.1
Kaiser Aluminum Corp.	6.50%	05/01/2025		26		26,654	0.0
OCI NV	5.25%	11/01/2024		200		195,933	0.2
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029		66		59,635	0.1
Peabody Energy Corp.	6.00%	03/31/2022		113		77,575	0.1
PolyOne Corp.	5.75%	05/15/2025		38		39,819	0.0
Sealed Air Corp.	6.88%	07/15/2033		32		37,786	0.0
Starfruit Finco BV/Starfruit US Holdco LLC	6.50%	10/01/2026	EUR	100		108,792	0.1
United States Steel Corp.	12.00%	06/01/2025	USD	110		110,332	0.1
Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030		47		46,866	0.1
						1,817,953	2.0
INVESTITIONSGÜTER							
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	2.75%	03/15/2024	EUR	100		111,677	0.1
Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024	USD	36		22,065	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025		47		28,554	0.0
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027		72		42,675	0.1
Clean Harbors, Inc.	4.88%	07/15/2027		132		136,636	0.2
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029		45		47,434	0.1
Cleaver-Brooks, Inc.	7.88%	03/01/2023		31		26,117	0.0
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026		21		22,093	0.0
Crown European Holdings SA	2.88%	02/01/2026	EUR	504		562,646	0.6
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026	USD	147		143,325	0.2
GFL Environmental, Inc.	5.13%	12/15/2026		11		11,489	0.0
GFL Environmental, Inc.	7.00%	06/01/2026		34		35,944	0.1
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028		217		214,719	0.3
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025		9		8,606	0.0
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	5.50%	04/15/2024		29		28,977	0.0
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027		12		11,484	0.0
OI European Group BV	3.13%	11/15/2024	EUR	325		355,485	0.4
Signature Aviation US Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2028	USD	110		97,567	0.1
Terex Corp.	5.63%	02/01/2025		28		26,044	0.0
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024		41		35,139	0.0
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025		65		43,260	0.1
						2,011,936	2.3
KOMMUNIKATIONSMEDIEN							
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.50%	05/01/2026		50		52,812	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.75%	02/15/2026		3		3,124	0.0
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027		51		51,000	0.1
Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co.	5.38%	08/15/2026		12		9,526	0.0
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026		78		80,936	0.1
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026		3		3,488	0.0
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027		6		5,633	0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029		8		8,214	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027		224		233,491	0.3
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026		61		56,485	0.1
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	4.63%	03/15/2030		35		32,264	0.0
Radiate Holdco LLC/Radiate Finance, Inc.	6.88%	02/15/2023		42		42,801	0.0
Scripps Escrow, Inc.	5.88%	07/15/2027		50		46,495	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030		114		105,461	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	4.63%	07/15/2024		43		44,017	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029		3		3,224	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029		135		128,251	0.1
Univision Communications, Inc.	5.13%	05/15/2023		36		35,032	0.0
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025		15		14,329	0.0
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025		31		33,291	0.0
Virgin Media Receivables Financing Notes I DAC	5.50%	09/15/2024	GBP	390		488,548	0.5
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	USD	230		237,077	0.3
						1,715,499	1.9

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION							
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	USD	9	$	9,392	0.0%
Intelsat Jackson Holdings SA(a)	5.50%	08/01/2023		41		22,120	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(a)	8.50%	10/15/2024		40		23,274	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA.	9.50%	09/30/2022		40		44,981	0.1
Nexstar Broadcasting, Inc.	5.63%	07/15/2027		77		78,913	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038		3		3,637	0.0
Zayo Group Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2027		27		26,569	0.0
Zayo Group Holdings, Inc.	6.13%	03/01/2028		90		89,169	0.1
						298,055	0.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ							
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025		68		72,939	0.1
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029		8		8,174	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028		177		151,187	0.2
Exide Technologies, (First Lien)(a) (b)	11.00%	10/31/2024		18		0	0.0
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023		70		72,646	0.1
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025		18		18,905	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	4.06%	11/01/2024		220		207,452	0.2
Garrett LX I SARL/Garrett Borrowing LLC	5.13%	10/15/2026	EUR	104		76,336	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.63%	05/15/2025		100		108,402	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.75%	09/15/2026		320		337,393	0.4
Navistar International Corp.	9.50%	05/01/2025	USD	75		81,204	0.1
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	6.25%	05/15/2026		15		15,370	0.0
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	8.50%	05/15/2027		61		59,780	0.1
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2026		138		70,196	0.1
Titan International, Inc.	6.50%	11/30/2023		50		27,404	0.0
Truck Hero, Inc.	8.50%	04/21/2024		43		38,700	0.0
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025		170		165,778	0.2
						1,511,866	1.7
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG							
Cedar Fair LP	5.25%	07/15/2029		3		2,839	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op	5.50%	05/01/2025		207		211,328	0.2
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027		118		120,673	0.1
Mattel, Inc.	6.75%	12/31/2025		16		16,757	0.0
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025		130		133,550	0.2
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025		42		44,352	0.1
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025		29		30,548	0.0
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028		54		44,246	0.1
						604,293	0.7
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE							
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025		73		67,138	0.1
AZEK Co. LLC (The)	9.50%	05/15/2025		56		59,918	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	5.88%	10/15/2027		35		32,930	0.0
Boyd Gaming Corp.	8.63%	06/01/2025		17		18,146	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US Corp.	4.88%	02/15/2030		16		13,521	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US Corp.	6.25%	09/15/2027		132		125,659	0.1
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025		60		58,823	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	4.88%	01/15/2030		3		2,982	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.13%	05/01/2026		75		75,591	0.1
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028		10		10,120	0.0
K. Hovnanian Enterprises, Inc.	10.00%	07/15/2022		86		42,220	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025		53		54,872	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC	6.50%	09/15/2026		14		13,914	0.0
Mattamy Group Corp.	5.25%	12/15/2027		92		88,537	0.1
Meritage Homes Corp.	7.00%	04/01/2022		15		15,725	0.0
MGM Resorts International	5.50%	04/15/2027		91		88,530	0.1
Samsonite Finco SARL	3.50%	05/15/2026	EUR	118		104,222	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	USD	65		60,328	0.1
Stars Group Holdings BV/Stars Group US Co-Borrower LLC	7.00%	07/15/2026		85		90,211	0.1
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp.	5.88%	05/15/2025		37		33,695	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027		79		78,751	0.1
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	5.38%	04/15/2026		3		2,863	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025		3		2,911	0.0
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029		66		63,449	0.1
						1,205,056	1.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS							
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	5.75%	04/15/2025		34		36,130	0.0
IRB Holding Corp.	6.75%	02/15/2026		108		101,195	0.1
IRB Holding Corp.	7.00%	06/15/2025		53		54,934	0.1
Yum! Brands, Inc.	7.75%	04/01/2025		81		89,643	0.1
						281,902	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
Asbury Automotive Group, Inc.	4.50%	03/01/2028	USD	26	$ 24,797	0.0%
Asbury Automotive Group, Inc.	4.75%	03/01/2030		18	17,280	0.0
Burlington Coat Factory Warehouse Corp.	6.25%	04/15/2025		13	13,492	0.0
FirstCash, Inc.	5.38%	06/01/2024		5	5,028	0.0
L Brands, Inc.	5.25%	02/01/2028		14	11,829	0.0
L Brands, Inc.	5.63%	10/15/2023		52	50,151	0.1
L Brands, Inc.	6.75%	07/01/2036		35	29,106	0.0
L Brands, Inc.	6.88%	11/01/2035		40	33,092	0.0
L Brands, Inc.	6.95%	03/01/2033		4	2,684	0.0
L Brands, Inc.	7.50%	06/15/2029		14	12,366	0.0
PetSmart, Inc.	7.13%	03/15/2023		102	98,901	0.1
Rite Aid Corp.	7.50%	07/01/2025		150	149,388	0.2
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026		104	91,022	0.1
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024		46	43,718	0.1
William Carter Co. (The)	5.50%	05/15/2025		49	50,568	0.1
William Carter Co. (The)	5.63%	03/15/2027		51	52,250	0.1
					685,672	0.8
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Air Medical Group Holdings, Inc.	6.38%	05/15/2023		57	54,442	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.63%	01/15/2027		77	78,297	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.88%	02/15/2030		53	54,925	0.1
Avantor, Inc.	9.00%	10/01/2025		20	21,601	0.0
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027		59	64,570	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	6.13%	04/15/2025		33	33,580	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	7.25%	05/30/2029		17	18,335	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	9.00%	12/15/2025		41	44,921	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.25%	03/31/2023		74	71,762	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.63%	02/15/2025		45	43,321	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	8.13%	06/30/2024		5	3,579	0.0
Envision Healthcare Corp.	8.75%	10/15/2026		65	28,600	0.0
Grifols SA	3.20%	05/01/2025	EUR	434	485,381	0.5
LifePoint Health, Inc.	4.38%	02/15/2027	USD	98	95,097	0.1
MEDNAX, Inc.	6.25%	01/15/2027		3	2,831	0.0
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030		105	104,008	0.1
Radiology Partners, Inc.	9.25%	02/01/2028		67	64,688	0.1
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc.	9.75%	12/01/2026		125	135,313	0.2
Tenet Healthcare Corp.	6.75%	06/15/2023		90	94,249	0.1
Tenet Healthcare Corp.	7.50%	04/01/2025		59	64,135	0.1
					1,563,635	1.8
ENERGIE						
Antero Resources Corp.	5.13%	12/01/2022		46	32,919	0.0
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026		61	46,126	0.1
Callon Petroleum, Co.	6.25%	04/15/2023		29	9,507	0.0
Cheniere Energy Partners LP	4.50%	10/01/2029		38	37,117	0.1
Cheniere Energy Partners LP	5.63%	10/01/2026		18	18,345	0.0
CITGO Petroleum Corp.	6.25%	08/15/2022		126	124,110	0.1
Denbury Resources, Inc.	9.25%	03/31/2022		40	16,914	0.0
Diamond Offshore Drilling, Inc.	7.88%	08/15/2025		25	2,749	0.0
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024		8	6,556	0.0
EP Energy LLC/Everest Acquisition Finance, Inc.(a)	8.00%	02/15/2025		30	71	0.0
EP Energy LLC/Everest Acquisition Finance, Inc.(a)	9.38%	05/01/2024		22	262	0.0
EQT Corp.	3.90%	10/01/2027		5	4,386	0.0
EQT Corp.(c)	7.00%	02/01/2030		131	138,942	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024		51	46,679	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028		150	140,116	0.2
Gulfport Energy Corp.	6.00%	10/15/2024		27	15,762	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.38%	05/15/2025		43	21,799	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.38%	01/15/2026		35	17,362	0.0
Hess Midstream Operations LP	5.63%	02/15/2026		138	133,812	0.2
HighPoint Operating Corp.	7.00%	10/15/2022		10	2,819	0.0
Indigo Natural Resources LLC	6.88%	02/15/2026		38	36,766	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026		52	29,631	0.0
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028		50	27,499	0.0
Nabors Industries, Inc.	5.75%	02/01/2025		33	10,230	0.0
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023		79	61,454	0.1
Noble Holding International Ltd.	7.75%	01/15/2024		7	167	0.0
Noble Holding International Ltd.(c)	7.95%	04/01/2025		55	1,386	0.0
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023		99	85,202	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024		38	36,151	0.0
QEP Resources, Inc.	5.25%	05/01/2023		32	17,067	0.0
Range Resources Corp.	5.00%	08/15/2022		2	1,872	0.0

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023	USD	9	$ 8,134	0.0%
SM Energy Co.	5.63%	06/01/2025		24	12,444	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028		39	39,496	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	6.00%	04/15/2027		5	5,128	0.0
Transocean Pontus Ltd.	6.13%	08/01/2025		26	24,498	0.0
Transocean, Inc.	7.50%	01/15/2026		12	6,623	0.0
Transocean, Inc.	8.00%	02/01/2027		75	41,022	0.1
Vine Oil & Gas LP/Vine Oil & Gas Finance Corp.	8.75%	04/15/2023		176	117,008	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025		8	7,439	0.0
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022		16	15,714	0.0
Western Midstream Operating LP(c)	4.05%	02/01/2030		38	34,096	0.0
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028		45	41,054	0.1
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044		13	10,614	0.0
Whiting Petroleum Corp.	6.25%	04/01/2023		19	2,199	0.0
Whiting Petroleum Corp.	6.63%	01/15/2026		19	2,168	0.0
					1,491,415	1.7
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	4.00%	01/15/2028		43	43,209	0.1
Belden, Inc.	2.88%	09/15/2025	EUR	440	457,169	0.5
H&E Equipment Services, Inc.	5.63%	09/01/2025	USD	9	8,810	0.0
IAA, Inc.	5.50%	06/15/2027		3	3,062	0.0
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025		3	2,843	0.0
Laureate Education, Inc.	8.25%	05/01/2025		30	31,693	0.0
					546,786	0.6
DIENSTLEISTUNGEN						
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026		35	36,974	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027		68	72,250	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027		154	145,050	0.2
APX Group, Inc.	7.88%	12/01/2022		29	30,305	0.0
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025		55	57,494	0.1
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023	EUR	100	90,816	0.1
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027	USD	50	51,975	0.1
Monitronics International, Inc.	9.13%	04/01/2021		62	0	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024		3	3,127	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028		106	100,709	0.1
Refinitiv US Holdings, Inc.	8.25%	11/15/2026		18	19,771	0.0
Sabre GLBL, Inc.	9.25%	04/15/2025		33	35,407	0.0
					643,878	0.7
TECHNOLOGIE						
Banff Merger Sub, Inc.	9.75%	09/01/2026		97	97,308	0.1
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025		6	6,338	0.0
CDW LLC/CDW Finance Corp.	4.13%	05/01/2025		34	34,894	0.1
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024		29	29,785	0.0
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026		17	17,904	0.0
CommScope, Inc.	8.25%	03/01/2027		42	43,800	0.1
Microchip Technology, Inc.	4.25%	09/01/2025		21	21,124	0.0
NCR Corp.	8.13%	04/15/2025		31	33,329	0.0
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027		7	6,917	0.0
Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028		7	6,923	0.0
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028		12	12,269	0.0
					310,591	0.3
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Algeco Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023		200	186,268	0.2
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027		34	26,057	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	10.50%	05/15/2025		83	92,353	0.1
Europcar Mobility Group	4.13%	11/15/2024	EUR	105	74,911	0.1
Heathrow Finance PLC	3.88%	03/01/2027	GBP	410	450,620	0.5
Hertz Corp. (The)(a)	6.00%	01/15/2028	USD	95	16,129	0.0
Hertz Corp. (The)(a)	7.13%	08/01/2026		8	1,352	0.0
United Rentals North America, Inc.	6.50%	12/15/2026		3	3,208	0.0
XPO Logistics, Inc.	6.75%	08/15/2024		90	94,418	0.1
					945,316	1.1
					15,633,853	17.6
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Alliance Data Systems Corp.	4.75%	12/15/2024		123	110,067	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(d)	5.88%	09/24/2023	EUR	200	213,381	0.2
Banco Santander SA(d)	6.75%	04/25/2022		400	452,686	0.5
Citizens Financial Group, Inc., Series A(d) (e)	5.33%	07/06/2020	USD	10	8,511	0.0
Credit Suisse Group AG(d)	6.25%	12/18/2024		200	210,473	0.2
Credit Suisse Group AG(d)	6.38%	08/21/2026		210	214,197	0.3
Societe Generale SA(d)	8.00%	09/29/2025		200	215,087	0.3
					1,424,402	1.6

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
MAKLER								
	LPL Holdings, Inc.	5.75%	09/15/2025	USD	52	$	54,252	0.1%
	NFP Corp.	6.88%	07/15/2025		32		30,856	0.0
	NFP Corp.	7.00%	05/15/2025		46		47,665	0.0
							132,773	0.1
FINANZEN								
	Compass Group Diversified Holdings LLC	8.00%	05/01/2026		8		8,493	0.0
	goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024		82		77,197	0.1
	Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR	111		112,006	0.1
							197,696	0.2
VERSICHERUNGEN								
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	7.00%	11/15/2025	USD	61		57,941	0.1
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	10.13%	08/01/2026		42		43,861	0.1
	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer	6.75%	10/15/2027		19		19,450	0.0
	HUB International Ltd.	7.00%	05/01/2026		25		25,661	0.0
	Polaris Intermediate Corp.(b)	8.50%	12/01/2022		149		130,239	0.1
							277,152	0.3
SONSTIGE FINANZWERTE								
	Intrum AB	2.75%	07/15/2022	EUR	80		82,588	0.1
	Intrum AB	3.00%	09/15/2027		100		91,244	0.1
							173,832	0.2
REITS								
	Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	USD	61		46,355	0.1
	Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025		75		76,283	0.1
	Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2027		3		3,006	0.0
	Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028		43		43,783	0.0
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.75%	02/01/2027		65		68,183	0.1
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	9.38%	04/01/2027		100		86,902	0.1
	SBA Communications Corp.	3.88%	02/15/2027		75		76,288	0.1
							400,800	0.5
							2,606,655	2.9
VERSORGUNGSBETRIEBE								
ELEKTRIZITÄT								
	Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028		87		88,295	0.1
	NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027		3		3,203	0.0
	Talen Energy Supply LLC	7.25%	05/15/2027		43		43,939	0.0
	Talen Energy Supply LLC	10.50%	01/15/2026		74		56,698	0.1
	Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027		3		3,184	0.0
							195,319	0.2
							18,435,827	20.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT								
INDUSTRIE								
GRUNDSTOFFE								
	Anglo American Capital PLC	5.38%	04/01/2025		208		228,097	0.3
	ArcelorMittal SA	4.55%	03/11/2026		101		103,469	0.1
	ArcelorMittal SA(c)	7.00%	03/01/2041		35		41,346	0.0
	ArcelorMittal SA(c)	7.25%	10/15/2039		37		44,069	0.1
	Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025		25		25,925	0.0
							442,906	0.5
INVESTITIONSGÜTER								
	Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027		28		25,504	0.1
	General Electric Co.	0.88%	05/17/2025	EUR	246		254,515	0.3
	General Electric Co.	3.45%	05/01/2027	USD	10		9,940	0.0
	General Electric Co.	3.63%	05/01/2030		16		15,815	0.0
	Westinghouse Air Brake Technologies Corp.(c)	4.40%	03/15/2024		18		18,343	0.0
							324,117	0.4
KOMMUNIKATIONSMEDIEN								
	Interpublic Group of Cos., Inc. (The)	4.75%	03/30/2030		90		100,705	0.1
	Omnicom Group, Inc.	4.20%	06/01/2030		28		30,394	0.0
	ViacomCBS, Inc.	3.70%	08/15/2024		63		66,580	0.1
	ViacomCBS, Inc.	4.75%	05/15/2025		188		205,917	0.2
	Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024		205		209,675	0.3
							613,271	0.7
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION								
	Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025		205		217,476	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ								
	BMW US Capital LLC	3.90%	04/09/2025		286		308,878	0.4
	General Motors Financial Co., Inc.	2.20%	04/01/2024	EUR	450		485,746	0.5

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
General Motors Financial Co., Inc.	5.10%	01/17/2024	USD	276	$ 286,848	0.3%
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.88%	05/19/2023	EUR	235	267,480	0.3
Hyundai Capital America	5.88%	04/07/2025	USD	293	321,241	0.4
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030		23	20,459	0.0
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027		25	23,853	0.0
Volkswagen Group of America Finance LLC	3.35%	05/13/2025		215	223,931	0.3
					1,938,436	2.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG						
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023		282	299,789	0.3
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023		117	121,973	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025		229	241,595	0.3
					663,357	0.8
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Lennar Corp.	4.75%	11/29/2027		3	3,270	0.0
Marriott International, Inc./MD	5.75%	05/01/2025		33	35,742	0.1
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043		30	31,499	0.0
					70,511	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
PVH Corp.	3.13%	12/15/2027	EUR	430	439,697	0.5
Ross Stores, Inc.	4.60%	04/15/2025	USD	148	165,295	0.1
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027		55	62,091	0.1
VF Corp.	2.40%	04/23/2025		99	102,853	0.1
VF Corp.	2.80%	04/23/2027		58	60,308	0.1
					830,244	0.9
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Cigna Corp.	3.00%	07/15/2023		141	147,878	0.2
Kraft Heinz Foods Co.	3.95%	07/15/2025		33	34,580	0.0
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	3.05%	01/15/2026		79	83,582	0.1
					266,040	0.3
ENERGIE						
BP Capital Markets America, Inc.	3.19%	04/06/2025		164	177,812	0.2
Ecopetrol SA	5.88%	09/18/2023		6	6,468	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045		34	35,332	0.0
Equinor ASA	2.88%	04/06/2025		211	226,965	0.3
Kinder Morgan, Inc./DE, Series G	7.75%	01/15/2032		20	26,590	0.0
Marathon Petroleum Corp.	4.50%	05/01/2023		139	148,214	0.2
Marathon Petroleum Corp.	4.70%	05/01/2025		124	137,096	0.2
ONEOK, Inc.	2.20%	09/15/2025		40	38,074	0.0
ONEOK, Inc.	5.85%	01/15/2026		155	171,033	0.2
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	9.25%	05/15/2025		101	109,350	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026		30	30,494	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.65%	10/15/2025		67	68,459	0.1
Shell International Finance BV	2.38%	04/06/2025		76	80,834	0.1
Sunoco Logistics Partners Operations LP	3.90%	07/15/2026		12	12,008	0.0
					1,268,729	1.4
DIENSTLEISTUNGEN						
Booking Holdings, Inc.	4.10%	04/13/2025		74	80,704	0.1
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025		61	65,164	0.1
Expedia Group, Inc.	7.00%	05/01/2025		129	137,950	0.1
					283,818	0.3
TECHNOLOGIE						
Analog Devices, Inc.	2.95%	04/01/2025		38	40,252	0.1
Baidu, Inc.	3.08%	04/07/2025		295	307,001	0.3
Broadcom, Inc.	4.25%	04/15/2026		147	157,432	0.2
Dell International LLC/EMC Corp.	4.90%	10/01/2026		88	95,312	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025		23	25,719	0.0
KLA Corp.	4.65%	11/01/2024		57	64,362	0.1
Leidos, Inc.	2.95%	05/15/2023		38	39,397	0.0
Leidos, Inc.	3.63%	05/15/2025		21	22,541	0.0
NXP BV/NXP Funding LLC	3.88%	09/01/2022		200	209,215	0.2
NXP BV/NXP Funding LLC	5.35%	03/01/2026		130	148,670	0.2
VMware, Inc.	4.50%	05/15/2025		126	136,150	0.2
					1,246,051	1.4
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN						
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025		208	215,274	0.3
Southwest Airlines Co.	4.75%	05/04/2023		106	107,552	0.1
Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025		109	110,752	0.1
					433,578	0.5
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN						
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036		269	280,164	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022	USD 16	$ 13,434	0.0%
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	16	11,045	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023	43	34,258	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	39	28,991	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	19	13,712	0.0
				101,440	0.1
				8,980,138	10.1
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	501	520,597	0.6
AIB Group PLC	4.75%	10/12/2023	200	210,564	0.2
Ally Financial, Inc.	5.80%	05/01/2025	37	40,606	0.1
American Express Co., Series C(d) (e)	4.03%	09/15/2020	35	29,440	0.0
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	4.50%	03/19/2024	305	326,884	0.4
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025	214	228,927	0.3
Bank of America Corp., Series DD(d)	6.30%	03/10/2026	129	141,928	0.2
Bank of America Corp., Series X(d)	6.25%	09/05/2024	190	198,509	0.2
Bank of America Corp., Series Z(d)	6.50%	10/23/2024	61	65,204	0.1
Bank of New York Mellon Corp. (The), Series E(d)	4.95%	09/20/2020	42	40,039	0.1
Barclays Bank PLC	10.18%	06/12/2021	91	97,742	0.1
Barclays PLC(d)	7.88%	03/15/2022	206	209,269	0.2
BNP Paribas SA(d)	6.75%	03/14/2022	200	205,664	0.2
Citigroup, Inc.	3.11%	04/08/2026	37	39,030	0.0
Citigroup, Inc.(d)	5.95%	01/30/2023	77	77,294	0.1
Citigroup, Inc., Series Q(d)	5.95%	08/15/2020	46	42,414	0.1
Citigroup, Inc., Series T(d)	6.25%	08/15/2026	60	63,361	0.1
Citigroup, Inc., Series U(d)	5.00%	09/12/2024	110	102,999	0.1
Citigroup, Inc., Series V(d)	4.70%	01/30/2025	123	107,372	0.1
Cooperatieve Rabobank UA(d)	4.63%	12/29/2025	EUR 200	226,490	0.3
Credit Agricole SA/London	3.25%	10/04/2024	USD 260	275,801	0.3
Danske Bank A/S, Series E(d)	5.88%	04/06/2022	EUR 200	224,739	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series M(d) (e)	4.37%	06/29/2020	USD 36	32,525	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(d)	5.30%	11/10/2026	6	6,110	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(d)	5.00%	11/10/2022	41	37,765	0.0
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR 10,000	131,090	0.2
HSBC Holdings PLC(d)	6.00%	09/29/2023	EUR 302	349,910	0.4
ING Groep NV(d)	6.50%	04/16/2025	USD 328	332,078	0.4
ING Groep NV(d)	6.75%	04/16/2024	250	252,631	0.3
JPMorgan Chase & Co., Series FF(d)	5.00%	08/01/2024	159	149,441	0.2
JPMorgan Chase & Co., Series HH(d)	4.60%	02/01/2025	143	126,180	0.1
JPMorgan Chase & Co., Series V(d) (e)	4.75%	07/01/2020	2	1,702	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series Z(d) (e)	4.49%	08/01/2020	6	5,498	0.0
Lloyds Banking Group PLC(d)	7.50%	06/27/2024	217	222,221	0.3
Morgan Stanley, Series J(d)	5.55%	07/15/2020	42	37,528	0.0
Nationwide Building Society	3.62%	04/26/2023	250	256,138	0.3
Nordea Bank Abp(d)	6.63%	03/26/2026	435	462,932	0.5
Royal Bank of Scotland Group PLC(d)	8.63%	08/15/2021	200	208,254	0.2
Santander Holdings USA, Inc.	3.24%	10/05/2026	22	22,098	0.0
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	22	23,194	0.0
Standard Chartered PLC(d)	7.50%	04/02/2022	200	206,284	0.2
UBS Group AG(d)	7.00%	02/19/2025	200	218,045	0.2
UniCredit SpA, Series E	6.95%	10/31/2022	EUR 136	163,810	0.2
				6,720,307	7.6
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(d)	5.38%	06/01/2025	USD 125	131,203	0.1
FINANZEN					
Synchrony Financial	2.85%	07/25/2022	60	59,224	0.1
Synchrony Financial	4.25%	08/15/2024	17	16,995	0.0
Synchrony Financial	4.38%	03/19/2024	38	38,296	0.0
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025	49	49,375	0.1
				163,890	0.2
VERSICHERUNGEN					
ASR Nederland NV	3.38%	05/02/2049	EUR 170	194,473	0.2
Assicurazioni Generali SpA, Series E	5.50%	10/27/2047	220	273,609	0.3
Centene Corp.	4.25%	12/15/2027	USD 35	36,588	0.0
Centene Corp.	4.75%	01/15/2025	40	41,170	0.1
Centene Corp.	5.38%	08/15/2026	3	3,184	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(e)	2.52%	02/12/2047	55	43,965	0.1
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	100	126,315	0.1
MetLife, Inc.	6.40%	12/15/2036	7	8,096	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	29	29,260	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	78	80,886	0.1

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
	Voya Financial, Inc.	5.65%	05/15/2053	USD	151	$ 149,910	0.25
						987,456	1.1
REITS							
	Equinix, Inc.	2.88%	10/01/2025	EUR	430	485,129	0.6
	GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	USD	63	63,314	0.1
	GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026		32	32,169	0.0
	GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.75%	06/01/2028		52	52,257	0.1
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029		23	22,924	0.0
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027		9	9,299	0.0
	Sabra Health Care LP	4.80%	06/01/2024		88	86,382	0.1
	Spirit Realty LP	4.45%	09/15/2026		40	38,296	0.0
						789,770	0.9
						8,792,626	9.9
						17,772,764	20.0
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN							
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH							
	Bellemeade Re Ltd.						
	Series 2018-2A, Class M1B(e)	1.52%	08/25/2028		297	286,262	0.3
	Series 2019-1A, Class M2(e)	2.87%	03/25/2029		162	124,393	0.1
	Series 2019-2A, Class M1C(e)	2.17%	04/25/2029		324	301,625	0.3
	Series 2019-4A, Class M1C(e)	2.67%	10/25/2029		193	169,712	0.2
	Connecticut Avenue Securities Trust						
	Series 2018-R07, Class 1M2(e)	2.57%	04/25/2031		68	66,933	0.1
	Series 2019-R01, Class 2M2(e)	2.62%	07/25/2031		195	191,725	0.2
	Series 2019-R02, Class 1M2(e)	2.47%	08/25/2031		108	105,413	0.1
	Series 2019-R03, Class 1M2(e)	2.32%	09/25/2031		188	183,992	0.2
	Series 2019-R05, Class 1M2(e)	2.17%	07/25/2039		197	193,068	0.2
	Series 2019-R06, Class 2M2(e)	2.27%	09/25/2039		379	368,801	0.4
	Series 2019-R07, Class 1M2(e)	2.27%	10/25/2039		510	480,700	0.6
	Eagle RE Ltd., Series 2018-1, Class M1(e)	1.87%	11/25/2028		52	49,448	0.1
	Federal Home Loan Mortgage Corp						
	Series 2019-DNA4, Class M2(e)	2.12%	10/25/2049		313	295,497	0.3
	Series 2019-HQA1, Class M2(e)	2.52%	02/25/2049		116	109,341	0.1
	Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes						
	Series 2014-HQ3, Class M3(e)	4.92%	10/25/2024		640	654,256	0.7
	Series 2016-DNA1, Class B(e)	10.17%	07/25/2028		247	212,868	0.2
	Series 2016-DNA2, Class M3(e)	4.82%	10/25/2028		200	209,157	0.2
	Series 2017-HQA3, Class M2(e)	2.52%	04/25/2030		419	417,342	0.5
	Series 2019-DNA3, Class M2(e)	2.22%	07/25/2049		64	61,230	0.1
	Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities						
	Series 2014-C01, Class M2(e)	4.57%	01/25/2024		230	193,157	0.2
	Series 2014-C02, Class 1M2(e)	2.77%	05/25/2024		82	63,857	0.1
	Series 2014-C04, Class 1M2(e)	5.07%	11/25/2024		71	73,088	0.1
	Series 2014-C04, Class 2M2(e)	5.17%	11/25/2024		122	121,978	0.1
	Series 2015-C01, Class 1M2(e)	4.47%	02/25/2025		96	91,919	0.1
	Series 2015-C01, Class 2M2(e)	4.72%	02/25/2025		41	41,308	0.1
	Series 2015-C02, Class 1M2(e)	4.17%	05/25/2025		1,080	1,020,028	1.2
	Series 2015-C02, Class 2M2(e)	4.17%	05/25/2025		96	95,048	0.1
	Series 2015-C03, Class 1M2(e)	5.17%	07/25/2025		180	180,040	0.2
	Series 2015-C03, Class 2M2(e)	5.17%	07/25/2025		85	85,642	0.1
	Series 2015-C04, Class 1M2(e)	5.87%	04/25/2028		105	110,699	0.1
	Series 2015-C04, Class 2M2(e)	5.72%	04/25/2028		312	327,852	0.4
	Series 2016-C02, Class 1M2(e)	6.17%	09/25/2028		9	9,849	0.0
	Series 2016-C04, Class 1M2(e)	4.42%	01/25/2029		17	17,079	0.0
	Series 2016-C05, Class 2M2(e)	4.62%	01/25/2029		119	122,024	0.1
	Series 2017-C02, Class 2B1(e)	5.67%	09/25/2029		195	166,497	0.2
	Series 2017-C06, Class 1M2(e)	2.82%	02/25/2030		449	439,962	0.5
	Series 2017-C06, Class 2M2(e)	2.97%	02/25/2030		394	383,149	0.4
	Series 2017-C07, Class 1M2(e)	2.57%	05/25/2030		479	468,556	0.5
	Series 2017-C07, Class 2M2(e)	2.67%	05/25/2030		635	609,712	0.7
	Series 2018-C01, Class 1M2(e)	2.42%	07/25/2030		30	29,173	0.0
	Series 2018-C05, Class 1B1(e)	4.42%	01/25/2031		152	126,143	0.2
	Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M1(e)	1.77%	10/25/2028		74	70,958	0.1
	Mortgage Insurance-Linked Notes, Series 2020-1, Class M1B(e)	1.62%	02/25/2030		150	136,670	0.2
	Radnor Re Ltd.						
	Series 2019-1, Class M1B(e)	2.12%	02/25/2029		152	147,016	0.2
	Series 2019-2, Class M1B(e)	1.92%	06/25/2029		289	258,034	0.3
						9,871,201	11.1
VARIABEL VERZINSLICHE STAATSPAPIERE							
	Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs						
	Series 3119, Class PI(e) (f)	7.02%	02/15/2036		80	20,327	0.0
	Series 4248, Class SL(e) (f)	5.87%	05/15/2041		49	9,682	0.0
	Series 4735, Class SA(e) (f)	6.02%	12/15/2047		545	130,415	0.1

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
	Series 4754, Class QS(e) (f)	5.97%	02/15/2048	USD	878	$	166,864	0.2%
	Series 4767, Class SB(e) (f)	6.02%	03/15/2048		806		137,261	0.2
	Series 4774, Class BS(e) (f)	6.02%	02/15/2048		2,313		377,125	0.4
	Series 4774, Class SL(e) (f)	6.02%	04/15/2048		926		156,388	0.2
	Federal National Mortgage Association REMICs							
	Series 2013-4, Class ST(e) (f)	5.98%	02/25/2043		184		37,726	0.0
	Series 2014-88, Class BS(e) (f)	5.98%	01/25/2045		184		37,222	0.0
	Series 2016-69, Class DS(e) (f)	5.93%	10/25/2046		1,900		376,322	0.4
	Series 2017-109, Class SJ(e) (f)	6.03%	01/25/2048		697		116,525	0.1
	Series 2017-20, Class SJ(e) (f)	5.93%	04/25/2047		870		173,786	0.2
	Series 2017-49, Class SP(e) (f)	5.98%	07/25/2047		160		34,237	0.0
	Series 2018-28, Class PS(e) (f)	6.03%	05/25/2048		878		156,688	0.2
	Series 2018-30, Class SA(e) (f)	6.03%	05/25/2048		909		149,613	0.2
	Series 2018-32, Class SB(e) (f)	6.03%	05/25/2048		350		74,247	0.1
	Series 2018-45, Class SL(e) (f)	6.03%	06/25/2048		227		50,693	0.1
	Series 2018-57, Class SL(e) (f)	6.03%	08/25/2048		1,090		173,820	0.2
	Series 2018-58, Class SA(e) (f)	6.03%	08/25/2048		393		62,134	0.1
	Series 2018-59, Class HS(e) (f)	6.03%	08/25/2048		1,095		163,863	0.2
							2,604,938	2.9
							12,476,139	14.0
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE								
AUSTRALIEN								
	Australia Government Bond, Series 124	5.75%	05/15/2021	AUD	980		687,132	0.8
INDONESIEN								
	Indonesia Treasury Bond, Series FR70	8.38%	03/15/2024	IDR	1,262,000		90,741	0.1
	Indonesia Treasury Bond, Series FR77	8.13%	05/15/2024		3,565,000		254,992	0.3
	Indonesia Treasury Bond, Series FR78	8.25%	05/15/2029		2,804,000		202,359	0.2
							548,092	0.6
MEXIKO								
	Mexican Bonos, Series M 20	7.50%	06/03/2027	MXN	15,961		785,701	0.9
VEREINIGTE STAATEN								
	U.S. Treasury Bonds(g)	6.00%	02/15/2026	USD	847		1,114,995	1.3
	U.S. Treasury Bonds	6.50%	11/15/2026		4,704		6,519,589	7.3
	U.S. Treasury Bonds(g)	6.75%	08/15/2026		783		1,086,657	1.2
	U.S. Treasury Notes(g)	1.63%	08/15/2029		676		737,463	0.8
							9,458,704	10.6
							11,479,629	12.9
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE								
ANGOLA								
	Angolan Government International Bond	8.25%	05/09/2028		200		123,313	0.1
	Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025		200		135,812	0.2
							259,125	0.3
BAHRAIN								
	Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028		200		208,750	0.2
COSTA RICA								
	Costa Rica Government International Bond	7.16%	03/12/2045		303		236,435	0.3
DOMINIKANISCHE REPUBLIK								
	Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030		229		198,944	0.2
	Dominican Republic International Bond	5.50%	01/27/2025		100		99,625	0.1
	Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027		130		126,222	0.2
	Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026		239		245,796	0.3
							670,587	0.8
ECUADOR								
	Ecuador Government International Bond	10.75%	03/28/2022		200		88,200	0.1
ÄGYPTEN								
	Egypt Government International Bond	5.75%	05/29/2024		218		218,136	0.3
	Egypt Government International Bond	6.13%	01/31/2022		200		202,875	0.2
	Egypt Government International Bond	6.20%	03/01/2024		327		332,314	0.4
	Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032		200		189,256	0.2
	Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032		218		213,684	0.2
							1,156,265	1.3
EL SALVADOR								
	El Salvador Government International Bond	7.75%	01/24/2023		10		8,956	0.0
GHANA								
	Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027		285		267,366	0.3
GUATEMALA								
	Guatemala Government Bond	5.38%	04/24/2032		344		372,165	0.4
HONDURAS								
	Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027		171		178,374	0.2

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ELFENBEINKÜSTE							
	Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	USD	200	$ 195,687	0.2%
KENIA							
	Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027		250	237,344	0.3
LIBANON							
	Lebanon Government International Bond	6.65%	04/22/2024		29	4,993	0.0
	Lebanon Government International Bond	6.85%	03/23/2027		28	4,830	0.0
	Lebanon Government International Bond, Series G	1.00%	11/27/2026		144	25,110	0.0
						34,933	0.0
NIGERIA							
	Nigeria Government International Bond	6.38%	07/12/2023		200	195,187	0.2
	Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027		355	314,952	0.4
						510,139	0.6
OMAN							
	Oman Government International Bond	4.13%	01/17/2023		260	239,281	0.3
	Oman Government International Bond	6.00%	08/01/2029		216	180,023	0.2
						419,304	0.5
SENEGAL							
	Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048		200	180,125	0.2
SÜDAFRIKA							
	Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029		257	234,513	0.3
	Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	06/22/2030		225	218,742	0.2
						453,255	0.5
						5,477,010	6.2
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN							
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS							
	AB FCP I - Mortgage Income Portfolio - Class SA				8,783	648,071	0.7
	AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT				31,259	3,169,977	3.6
						3,818,048	4.3
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN							
KANADA							
	Province of Alberta Canada	3.40%	12/01/2023	CAD	687	543,370	0.6
	Province of British Columbia Canada, Series T	9.00%	08/23/2024		514	499,624	0.5
	Province of Manitoba Canada	7.75%	12/22/2025		444	437,803	0.5
	Province of Saskatchewan Canada	3.20%	06/03/2024		761	603,376	0.7
						2,084,173	2.3
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN							
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS							
	CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(h)	1.02%	02/10/2050	USD	982	44,803	0.1
	Citigroup Commercial Mortgage Trust						
	Series 2016-C3, Class XA(h)	1.16%	11/15/2049		1,962	84,359	0.1
	Series 2016-P3, Class XA(h)	1.70%	04/15/2049		3,338	232,064	0.3
	Commercial Mortgage Trust						
	Series 2015-CR27, Class XA(h)	1.09%	10/10/2048		374	13,896	0.0
	Series 2016-DC2, Class XA(h)	1.00%	02/10/2049		6,867	291,801	0.3
	GS Mortgage Securities Trust						
	Series 2011-GC5, Class D	5.39%	08/10/2044		90	65,151	0.1
	Series 2016-GS3, Class XA(h)	1.24%	10/10/2049		5,369	278,457	0.3
	JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust,						
	Series 2016-JP2, Class XA(h)	1.80%	08/15/2049		947	80,156	0.1
	JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust,						
	Series 2017-C5, Class XA(h)	0.94%	03/15/2050		1,744	85,071	0.1
	LB-UBS Commercial Mortgage Trust, Series 2006-C6, Class AJ	5.45%	09/15/2039		222	128,839	0.1
	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust,						
	Series 2015-C22, Class XA(h)	1.05%	04/15/2048		1,428	51,655	0.1
	UBS Commercial Mortgage Trust, Series 2012-C1, Class D	5.57%	05/10/2045		60	36,048	0.0
	Wells Fargo Commercial Mortgage Trust						
	Series 2015-LC20, Class XA(h)	1.31%	04/15/2050		871	37,013	0.0
	Series 2016-C32, Class XA(h)	1.27%	01/15/2059		1,481	76,539	0.1
	Series 2016-C33, Class XA(h)	1.71%	03/15/2059		4,039	256,245	0.3
	Series 2016-C36, Class XA(h)	1.30%	11/15/2059		2,636	152,558	0.2
	Series 2016-LC24, Class XA(h)	1.67%	10/15/2049		1,309	84,357	0.1
	Series 2016-LC25, Class XA(h)	0.98%	12/15/2059		1,038	41,955	0.0
	WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2014-LC14, Class C	4.34%	03/15/2047		11	9,508	0.0
						2,050,475	2.3
ABS-ANLEIHEN							
AUTOS – FESTVERZINSLICH							
	Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC,						
	Series 2018-1A, Class C	4.73%	09/20/2024		128	101,246	0.1
	Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2017-3A, Class D	5.28%	10/15/2024		350	339,510	0.4
	First Investors Auto Owner Trust, Series 2017-1A, Class E	5.86%	11/15/2023		550	559,813	0.6

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
	Flagship Credit Auto Trust, Series 2018-3, Class D	4.15%	12/16/2024	USD	30	$ 28,525	0.0%
						1,029,094	1.1
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS							
	Marlette Funding Trust						
	Series 2018-3A, Class C	4.63%	09/15/2028		233	212,430	0.3
	Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028		28	26,717	0.0
	SoFi Consumer Loan Program LLC, Series 2017-6, Class C	4.02%	11/25/2026		285	263,353	0.3
	SoFi Consumer Loan Program Trust						
	Series 2018-2, Class C	4.25%	04/26/2027		100	88,250	0.1
	Series 2018-3, Class C	4.67%	08/25/2027		239	205,850	0.2
						796,600	0.9
						1,825,694	2.0
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE							
QUASI-STAATSANLEIHEN							
BAHRAIN							
	Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	8.38%	11/07/2028		200	208,000	0.2
CHILE							
	Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031		213	227,910	0.3
	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	3.65%	05/07/2030		200	213,850	0.2
						441,760	0.5
MALAYSIA							
	Petronas Capital Ltd.	3.50%	04/21/2030		300	332,074	0.4
MEXIKO							
	Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031		204	164,985	0.2
	Petroleos Mexicanos	6.50%	01/23/2029		24	20,470	0.0
	Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030		97	82,934	0.1
	Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050		38	31,635	0.1
						300,024	0.4
PANAMA							
	Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	6.00%	11/18/2048		199	205,961	0.2
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE							
	MDGH - GMTN BV, Series G	2.88%	05/21/2030		214	221,489	0.3
VEREINIGTE STAATEN							
	Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024		31	30,090	0.0
						1,739,398	2.0
BEHÖRDEN							
SCHULDVERSCHREIBUNGEN VON BEHÖRDEN							
	Federal Home Loan Banks	5.50%	07/15/2036		135	210,864	0.2
	Federal Home Loan Mortgage Corp	6.25%	07/15/2032		222	350,200	0.4
	Federal Home Loan Mortgage Corp	6.75%	03/15/2031		200	315,402	0.4
	Federal National Mortgage Association	6.25%	05/15/2029		141	204,651	0.2
	Federal National Mortgage Association	6.63%	11/15/2030		400	621,341	0.7
						1,702,458	1.9
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS							
CLO – VARIABEL VERZINSLICH							
	CBAM Ltd., Series 2018-7A, Class B1(e)	2.74%	07/20/2031		278	266,216	0.3
	GoldenTree Loan Opportunities Ltd., Series 2014-9A, Class DR2(e)	3.84%	10/29/2029		250	228,732	0.3
	Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A2(e)	2.94%	07/21/2031		250	230,283	0.3
	Northwoods Capital Ltd., Series 2018-12BA, Class B(e)	2.59%	06/15/2031		250	228,064	0.2
	OZLM Ltd., Series 2018-18A, Class B(e)	2.77%	04/15/2031		300	283,321	0.3
	Rockford Tower CLO Ltd., Series 2017-2A, Class DR(e)	4.07%	10/15/2029		250	227,661	0.2
						1,464,277	1.6
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN							
ISRAEL							
	Israel Government International Bond	2.75%	07/03/2030		207	224,808	0.3
MEXIKO							
	Mexico Government International Bond	3.90%	04/27/2025		213	224,715	0.2
KATAR							
	Qatar Government International Bond	3.75%	04/16/2030		291	323,556	0.4
SAUDI-ARABIEN							
	Saudi Government International Bond	3.25%	10/22/2030		346	358,110	0.4
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE							
	Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	04/16/2030		292	313,097	0.3
						1,444,286	1.6
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN							
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
	Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025		150	126,726	0.1
	CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026		200	162,969	0.2
						289,695	0.3

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
INVESTITIONSGÜTER						
Odebrecht Finance Ltd.(a)	4.38%	04/25/2025	USD	225	$ 3,867	0.0%
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Digicel International Finance Ltd./ Digicel Holdings Bermuda Ltd.(b)	13.00%	12/31/2025		49	42,630	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026		297	281,872	0.3
Inretail Pharma SA	5.38%	05/02/2023		118	121,614	0.2
MARB BondCo PLC	6.88%	01/19/2025		200	200,945	0.2
					604,431	0.7
ENERGIE						
Petrobras Global Finance BV	6.90%	03/19/2049		255	252,741	0.3
					1,193,364	1.3
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
BRASILIEN						
Brazil Notas do Tesouro Nacional Series F	10.00%	01/01/2025	BRL	1,500	326,664	0.4
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominican Republic International Bond	16.95%	02/04/2022	USD	3,700	71,483	0.1
SÜDAFRIKA						
Republic of South Africa Government Bond Series 2023	7.75%	02/28/2023	ZAR	6,305	381,699	0.4
					779,846	0.9
SCHWELLENMÄRKTE – HARTWÄHRUNG						
INDUSTRIE						
Digicel International Finance Ltd./Digicel Holdings Bermuda Ltd.	8.00%	12/31/2026	USD	38	22,040	0.0
Digicel International Finance Ltd./Digicel Holdings Bermuda Ltd.	8.75%	05/25/2024		96	92,160	0.1
					114,200	0.1
BANKDARLEHEN						
FINANZINSTITUTE						
FINANZEN						
Jefferies Finance LLC(e)	3.19%	06/03/2026		4	3,495	0.0
INDUSTRIE						
TECHNOLOGIE						
Pitney Bowes Inc.(e)	5.68%	01/17/2025		84	66,528	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
U.S. Renal Care, Inc.(e)	5.19%	06/26/2026		22	20,951	0.0
					87,479	0.1
					90,974	0.1
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN						
VEREINIGTE STAATEN						
Tobacco Settlement Finance Authority, Series 2007A	7.47%	06/01/2047		45	45,044	0.1
					83,993,606	94.3
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS						
CLO – VARIABEL VERZINSLICH						
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(e)	2.74%	04/26/2031		300	278,279	0.3
Dryden CLO Ltd., Series 2018-57A, Class A(e)	1.40%	05/15/2031		250	243,198	0.3
Dryden Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(e)	7.44%	07/18/2030		250	205,456	0.2
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A2(e)	2.62%	04/26/2031		300	287,437	0.3
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A1(e)	2.02%	04/26/2031		250	241,594	0.3
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(e)	6.34%	01/20/2031		250	189,632	0.2
Sound Point CLO Ltd., Series 2018-1A, Class A(e)	2.22%	04/15/2031		500	479,998	0.6
					1,925,594	2.2
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
FINANZEN						
Enova International, Inc.	8.50%	09/01/2024		18	15,294	0.0
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025		50	42,874	0.1
					58,168	0.1
SONSTIGE FINANZWERTE						
Nordic Aviation Capital(i)	3.79%	02/27/2023		500	287,700	0.3
					345,868	0.4
INDUSTRIE						
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028		84	67,101	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Exide International Holdings LP, (Superpriority Lien)(a) (b) (i)	10.75%	10/31/2021		136	120,155	0.1
Exide Technologies, (Exchange Priority)(a) (b) (i)	11.00%	10/31/2024		54	5,363	0.0
					125,518	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Forestar Group, Inc.	5.00%	03/01/2028	USD 40	$ 37,656	0.1%
Forestar Group, Inc.	8.00%	04/15/2024	72	72,643	0.1
Twin River Worldwide Holdings, Inc.	6.75%	06/01/2027	40	36,834	0.0
				147,133	0.2
ENERGIE					
EP Energy LLC/Everest Acquisition Finance, Inc.(a)	7.75%	09/01/2022	76	41	0.0
Parkland Corp./Canada	6.00%	04/01/2026	86	86,867	0.1
				86,908	0.1
				426,660	0.5
				772,528	0.9
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-1R, Class A(e)	2.17%	03/27/2024	168	137,585	0.2
Series 2019-2R, Class A(e)	2.92%	05/27/2023	146	114,939	0.1
Series 2019-3R, Class A(e)	2.87%	10/27/2022	108	86,350	0.1
Series 2020-1R, Class A(e)	2.52%	02/27/2023	309	243,964	0.3
				582,838	0.7
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Madison Avenue Trust, Series 2013-650M, Class E	4.03%	10/12/2032	295	294,992	0.3
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2011-C4, Class E	5.22%	06/15/2044	25	12,584	0.0
				307,576	0.3
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class D(e)	4.18%	05/15/2036	64	49,011	0.1
				356,587	0.4
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	302	260,022	0.3
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	28	27,535	0.0
				287,557	0.3
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
TECHNOLOGIE					
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028	133	139,025	0.2
Broadcom, Inc.	4.25%	04/15/2026	125	133,871	0.1
				272,896	0.3
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-20, Class PT	8.37%	11/16/2043	108	96,650	0.1
Series 2019-36, Class PT	11.36%	10/17/2044	71	59,729	0.1
Series 2019-43, Class PT	5.44%	11/15/2044	54	48,796	0.0
				205,175	0.2
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
MEXIKO					
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	69	60,634	0.1
STAMMAKTIEN					
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
MEDIEN					
iHeartMedia, Inc., - Class A			69	600	0.0
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
ATD New Holdings, Inc.(i)			660	9,653	0.0
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
SOFTWARE					
Monitronics International, Inc.			1,157	3,339	0.0
Monitronics International, Inc.			1,152	3,456	0.0
				6,795	0.0
				17,048	0.0

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
OPTIONSSCHEINE						
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN						
MEDIEN						
iHeart Media, Inc., expiring 05/01/2039 (i)				518	$ 3,885	0.0%
BANKDARLEHEN						
INDUSTRIE						
ENERGIE						
California Resources Corporation(e)	11.38%	12/31/2021	USD	5	243	0.0
					4,484,985	5.1
GELDMARKTINSTRUMENTE						
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
ÄGYPTEN						
Egypt Treasury Bills, Series 273D	0.00%	07/28/2020	EGP	2,850	175,766	0.2
					4,660,751	5.3
Gesamtanlagen						
(Kosten $92,748,474)					$ 88,654,357	99.6%
Termineinlagen						
BBH, Grand Cayman(j)	0.01%	-			18,780	0.0
BBH, Grand Cayman(j)	0.04%	-			6	0.0
Sumitomo, Tokyo(j)	0.01%	-			1,198,884	1.3
Termineinlagen insgesamt					1,217,670	1.3
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					(839,669)	(0.9)
Nettovermögen					$ 89,032,358	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/30/2020	27	$ 3,359,086	$ 3,397,148	$ 38,062
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	29	3,638,594	3,643,125	4,531
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2020	196	27,201,469	27,256,250	54,781
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2020	9	1,957,016	1,962,281	5,265
Short					
Euro Buxl 30 Yr Bond Futures	06/08/2020	3	728,171	706,125	22,046
Euro-BOBL Futures	06/08/2020	9	1,360,977	1,350,209	10,768
Euro-Bund Futures	06/08/2020	7	1,357,713	1,340,075	17,638
Euro-Schatz Futures	06/08/2020	33	4,118,863	4,104,759	14,104
Long Gilt Futures	09/28/2020	10	1,696,519	1,697,384	(865)
U.S. 10 Yr Ultra Futures	09/21/2020	2	313,094	314,656	(1,562)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	15	3,312,070	3,312,656	(586)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	06/30/2020	27	3,352,633	3,397,148	(44,515)
					$ 119,667
				Wertsteigerung	$ 167,195
				Wertminderung	$ (47,528)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
BNP Paribas SA	USD	317	BRL	1,704	06/02/2020	$ 2,452
BNP Paribas SA	BRL	1,704	USD	316	07/02/2020	(2,438)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	1,242	USD	1,357	06/10/2020	(21,718)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	187	EUR	172	06/10/2020	4,120
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	6,618	USD	358	07/17/2020	(17,348)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	188	CAD	263	06/12/2020	3,033
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	20	CHF	20	06/12/2020	189
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	68	EUR	62	06/12/2020	1,614
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	433	GBP	351	06/12/2020	980
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	915	AUD	1,383	06/30/2020	6,488
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	413	PLN	1,667	06/30/2020	2,571
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,056	SGD	4,334	06/30/2020	12,328
Citibank, NA NY	AUD	1,050	USD	623	06/11/2020	(76,188)
Citibank, NA NY	GBP	729	USD	892	07/17/2020	(8,846)
Citibank, NA NY	INR	9,468	USD	121	07/23/2020	(3,537)
Citibank, NA NY	KRW	162,130	USD	133	08/13/2020	1,816
Goldman Sachs Capital Markets	MXN	17,088	USD	694	06/19/2020	(74,432)
Goldman Sachs Capital Markets	CAD	2,783	USD	2,007	08/06/2020	(14,600)
JPMorgan Chase Bank	IDR	10,082,894	USD	629	07/23/2020	(52,154)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	97	BRL	558	06/02/2020	$ 7,837
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	61	IDR	923,739	07/23/2020	1,386
UBS	BRL	2,261	USD	401	06/02/2020	(22,990)
UBS	EUR	5,953	USD	6,439	06/10/2020	(169,914)
						$ (419,351)
					Wertsteigerung	$ 44,814
					Wertminderung	$ (464,165)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)		Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Republic of Korea	06/20/2025	USD	1,120	$ (40,537)	$ (4,351)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025		12	(276)	540
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAIG Series 33, 5 Year Index	12/20/2024		130	(3,093)	(9,792)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Federative Republic of Brazil	06/20/2025		316	(27,262)	(2,552)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 33, 5 Year Index	06/20/2025	EUR	1,851	63,119	87,171
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Republic of Colombia	06/21/2025	USD	313	(11,030)	7,927
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Republic of South Africa	06/20/2025		324	(36,616)	6,811
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Turkey	06/20/2025		114	(22,165)	(2,749)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Russian Federation	06/20/2025		313	(2,910)	11,836
Insgesamt					$ (80,770)	$ 94,841
					Wertsteigerung	$ 114,285
					Wertminderung	$ (19,444)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal-betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 5,940	04/20/2023	2.850%	3 Month LIBOR	$ (439,385)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	1,550	10/30/2027	2.443%	3 Month LIBOR	(220,612)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	640	07/11/2027	2.372%	3 Month LIBOR	(84,658)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	150	05/07/2050	0.870%	3 Month LIBOR	2,789
Insgesamt					$ (741,866)
				Wertsteigerung	$ 2,789
				Wertminderung	$ (744,655)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)		Markt-wert	Vorab-gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte							
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD	450	$ 150,526	$ 57,847	$ 92,679
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		750	250,875	74,237	176,638
Verkaufskontrakte							
Citigroup Global Market, Inc.	BondABS.Towd	04/25/2057		1,338	(21,432)	0	(21,432)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063		1,000	(164,000)	(39,837)	(124,163)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		25	(8,363)	(6,729)	(1,634)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		31	(10,370)	(3,497)	(6,873)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		45	(15,052)	(11,101)	(3,951)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		46	(15,387)	(11,462)	(3,925)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		61	(20,405)	(15,048)	(5,357)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		71	(23,750)	(7,204)	(16,546)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		375	(125,438)	(55,285)	(70,153)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		443	(148,184)	(44,716)	(103,468)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		443	(148,184)	(44,238)	(103,946)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063		443	(148,183)	(44,238)	(103,945)

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Markt-wert	Vorab-gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Market, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 925	$ (309,413)	$ (99,212)	$ (210,201)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	29	(4,756)	(1,146)	(3,610)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	59	(9,676)	(2,377)	(7,299)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	70	(11,480)	(2,950)	(8,530)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	147	(24,108)	(5,809)	(18,299)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	36	(12,042)	(4,067)	(7,975)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	300	(49,200)	(12,117)	(37,083)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	800	(267,600)	(113,511)	(154,089)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,100	(367,950)	(173,693)	(194,257)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	300	(100,350)	(28,851)	(71,499)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	400	(133,800)	(50,493)	(83,307)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	591	(197,690)	(68,453)	(129,237)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	709	(237,161)	(82,276)	(154,885)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	200	(66,900)	(29,356)	(37,544)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	300	(100,350)	(44,049)	(56,301)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	400	(133,800)	(51,856)	(81,944)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	4	(594)	(148)	(446)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	600	(98,400)	(28,724)	(69,676)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	700	(234,150)	(106,567)	(127,583)
Insgesamt				$ (2,806,767)	$ (1,056,926)	$ (1,749,841)
					Wertsteigerung	$ 269,317
					Wertminderung	$ (2,019,158)
Swaps insgesamt						$ (2,396,866)

(a) Not leidend.

(b) Zahlungen in Sachwerten (PIK).

(c) Der Couponsatz wird regelmäßig auf der Grundlage eines vorgegebenen Zeitplans angepasst. Angegebener Zinssatz gültig am 31. Mai 2020.

(d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.

(e) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2020.

(f) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.

(g) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für Derivate zu dienen.

(h) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.

(i) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

(j) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
BRL – Brazilian Real
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
EGP – Egyptian Pound
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
IDR – Indonesian Rupiah
INR – Indian Rupee
KRW – South Korean Won
MXN – Mexican Peso
PLN – Polish Zloty
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ABS	–	Asset-Backed Securities
BOBL	–	Bundesobligationen
CBT	–	Chicago Board of Trade
CDX-CMBX.NA	–	North American Commercial Mortgage-Backed Index
CDX-NAHY	–	North American High Yield Credit Default Swap Index
CDX-NAIG	–	North American Investment Grade Credit Default Swap Index
CLO	–	Collateralized Loan Obligations
CMBS	–	Commercial Mortgage-Backed Securities
CME	–	Chicago Mercantile Exchange
INTRCONX	–	Inter-Continental Exchange
LIBOR	–	London Interbank Offered Rate
REIT	–	Real Estate Investment Trust
REMICs	–	Real Estate Mortgage Investment Conduits

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	1,226	$ 92,379	0.2%
Delphi Technologies PLC	25,687	330,848	0.8
Faurecia SE	1,368	53,040	0.2
		476,267	1.2
KRAFTFAHRZEUGE			
Fiat Chrysler Automobiles NV	33,707	300,852	0.7
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	4,840	83,486	0.2
Caesars Entertainment Corp.	34,647	394,630	1.0
Compass Group PLC	6,479	94,978	0.2
McDonald's Corp.	479	89,247	0.2
Paddy Power Betfair PLC	14,271	1,815,657	4.4
Transat AT, Inc.	46,982	232,035	0.6
		2,710,033	6.6
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	735	152,432	0.3
Amazon.com, Inc.	14	34,193	0.1
		186,625	0.4
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Dollar General Corp.	627	120,077	0.3
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	90	103,307	0.2
GrandVision NV	12,434	336,703	0.8
Home Depot, Inc. (The)	447	111,071	0.3
Ross Stores, Inc.	523	50,710	0.1
Tiffany & Co.	3,056	391,565	1.0
TJX Cos., Inc. (The)	670	35,349	0.1
Ulta Beauty, Inc.	436	106,388	0.3
		1,135,093	2.8
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
adidas AG	246	65,241	0.1
Deckers Outdoor Corp.	400	73,012	0.2
		138,253	0.3
		5,067,200	12.3
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONSAUSRÜSTUNG			
Acacia Communications, Inc.	5,882	397,035	1.0
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Amphenol Corp. - Class A	1,232	118,962	0.3
Fitbit, Inc. - Class A	33,400	211,756	0.5
Ingenico Group SA	2,976	414,229	1.0
KEMET Corp.	12,125	327,739	0.8
Keyence Corp.	320	131,808	0.3
Murata Manufacturing Co., Ltd.	2,000	112,495	0.3
		1,316,989	3.2
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Amadeus IT Group SA - Class A	750	39,219	0.1
Automatic Data Processing, Inc.	1,519	222,518	0.6
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	1,060	84,546	0.2
Capgemini SE	1,695	175,084	0.4
Fidelity National Information Services, Inc.	680	94,404	0.2
Mastercard, Inc. - Class A	1,008	303,297	0.7
Paychex, Inc.	770	55,656	0.2
		974,724	2.4
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV	548	179,514	0.4
Texas Instruments, Inc.	725	86,086	0.2
		265,600	0.6
SOFTWARE			
Check Point Software Technologies Ltd.	873	95,742	0.2
Citrix Systems, Inc.	850	125,902	0.3
Constellation Software, Inc./Canada	115	130,726	0.3
Microsoft Corp.	3,007	551,033	1.3
Nice Ltd.	426	79,049	0.2
Oracle Corp.	2,620	140,877	0.4

		Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
	Oracle Corp. Japan	1,000	$ 116,998	0.3%
	RIB Software SE (a)	10,376	334,018	0.8
	Temenos AG (a)	724	111,282	0.3
	TiVo Corp.	42,480	258,703	0.6
			1,944,330	4.7
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE				
	Apple, Inc.	475	151,021	0.4
			5,049,699	12.3
FINANZWERTE				
BANKEN				
	Bank Leumi Le-Israel BM	14,920	79,247	0.2
	CenterState Bank Corp.	8,683	137,191	0.3
	DBS Group Holdings Ltd.	2,200	30,436	0.1
	IBERIABANK Corp.	29,906	1,268,313	3.1
	JPMorgan Chase & Co.	340	33,085	0.1
	KBC Group NV	640	33,579	0.1
	Royal Bank of Canada	810	52,553	0.1
	Texas Capital Bancshares, Inc.	1,134	30,346	0.1
			1,664,750	4.1
KAPITALMÄRKTE				
	Charles Schwab Corp. (The)	4,009	143,963	0.3
	CME Group, Inc. - Class A	357	65,188	0.2
	E*TRADE Financial Corp.	8,375	381,398	0.9
	Legg Mason, Inc.	7,986	397,942	1.0
	Partners Group Holding AG (a)	93	77,476	0.2
	S&P Global, Inc.	255	82,880	0.2
	TD Ameritrade Holding Corp.	11,213	417,909	1.0
			1,566,756	3.8
VERSICHERUNGEN				
	Admiral Group PLC	2,120	61,235	0.1
	American Financial Group, Inc./OH	759	45,722	0.1
	Progressive Corp. (The)	470	36,510	0.1
	Reinsurance Group of America, Inc. - Class A	150	13,613	0.0
	RenaissanceRe Holdings Ltd.	370	62,108	0.1
	Sampo Oyj - Class A	2,030	72,939	0.2
	Swiss Re AG	370	25,268	0.1
	Willis Towers Watson PLC	1,927	390,988	1.0
	Zurich Insurance Group AG	92	29,771	0.1
			738,154	1.8
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG				
	Essent Group Ltd.	940	31,067	0.1
			4,000,727	9.8
GESUNDHEITSWESEN				
BIOTECHNOLOGIE				
	Genmab A/S	525	162,555	0.4
	Portola Pharmaceuticals, Inc.	13,968	250,725	0.6
	Progenics Pharmaceuticals, Inc.	82,228	349,058	0.9
			762,338	1.9
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF				
	Abbott Laboratories	1,914	181,677	0.4
	Wright Medical Group NV	13,339	394,167	1.0
			575,844	1.4
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN				
	Anthem, Inc.	220	64,704	0.2
	Galenica AG	840	62,228	0.1
	UnitedHealth Group, Inc.	441	134,439	0.3
			261,371	0.6
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN				
	Eurofins Scientific SE (a)	289	196,489	0.5
	IQVIA Holdings, Inc.	972	145,334	0.3
	QIAGEN NV	9,166	399,968	1.0
			741,791	1.8
PHARMAZEUTIKA				
	Astellas Pharma, Inc.	4,800	85,766	0.2
	Bristol-Myers Squibb Co.	1,070	63,900	0.2
	GlaxoSmithKline PLC	4,300	89,065	0.2
	Johnson & Johnson	570	84,787	0.2
	Merck & Co., Inc.	1,580	127,538	0.3
	Novo Nordisk A/S - Class B	1,870	122,494	0.3

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Roche Holding AG	531	$ 184,322	0.4%
Zoetis, Inc.	1,334	185,946	0.5
		943,818	2.3
		3,285,162	8.0
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
L3Harris Technologies, Inc.	594	118,473	0.3
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
CH Robinson Worldwide, Inc.	1,115	90,460	0.2
SG Holdings Co., Ltd.	1,000	32,698	0.1
		123,158	0.3
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Advanced Disposal Services, Inc.	12,382	386,071	1.0
Stericycle, Inc.	2,452	134,443	0.3
		520,514	1.3
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Nidec Corp.	1,400	86,180	0.2
OSRAM Licht AG - Class TEND (a)	7,924	358,086	0.9
		444,266	1.1
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Experian PLC	2,500	87,681	0.2
Intertrust NV	2,070	32,675	0.1
Recruit Holdings Co., Ltd.	3,500	120,564	0.3
RELX PLC	6,470	149,314	0.4
Verisk Analytics, Inc. - Class A	1,570	271,108	0.6
Wolters Kluwer NV	1,280	101,848	0.2
		763,190	1.8
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Ashtead Group PLC	3,594	107,325	0.3
		2,076,926	5.1
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Comcast Corp. - Class A	1,730	68,508	0.2
HKT Trust & HKT Ltd. - Class SS	42,000	59,749	0.1
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	3,100	70,560	0.2
		198,817	0.5
UNTERHALTUNG			
Walt Disney Co. (The)	819	96,069	0.2
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	51	72,875	0.2
Auto Trader Group PLC	14,290	99,327	0.2
Facebook, Inc. - Class A	937	210,909	0.5
Meet Group, Inc. (The)	32,887	203,242	0.5
Tencent Holdings Ltd.	2,600	140,805	0.4
		727,158	1.8
		1,022,044	2.5
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
PepsiCo, Inc.	620	81,561	0.2
Treasury Wine Estates Ltd.	15,813	101,669	0.2
		183,230	0.4
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	5,250	133,108	0.3
Walmart, Inc.	1,190	147,632	0.4
		280,740	0.7
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Morinaga & Co., Ltd./Japan	1,300	55,840	0.1
Nestle SA	2,416	262,322	0.6
Salmar ASA	2,160	97,409	0.3
		415,571	1.0
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The)	995	115,340	0.3
		994,881	2.4

	Zinssatz	Datum		Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
VERSORGUNG						
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE						
American Electric Power Co., Inc.				1,310	$ 111,677	0.3%
EDP - Energias de Portugal SA				11,660	54,471	0.1
Enel SpA				14,290	110,486	0.2
NextEra Energy, Inc.				285	72,835	0.2
					349,469	0.8
GASVERSORGUNGSBETRIEBE						
Tokyo Gas Co., Ltd.				1,800	43,096	0.1
MEHRFACH-VERSORGUNGSBETRIEBE						
Ameren Corp.				1,060	79,214	0.2
					471,779	1.1
IMMOBILIEN						
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)						
American Tower Corp.				370	95,523	0.3
Nippon Building Fund, Inc.				13	81,304	0.2
Taubman Centers, Inc.				1,197	49,484	0.1
					226,311	0.6
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG						
Vonovia SE				1,530	88,002	0.2
					314,313	0.8
GRUNDSTOFFE						
CHEMIKALIEN						
International Flavors & Fragrances, Inc.				820	109,216	0.3
ENERGIE						
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE						
Royal Dutch Shell PLC - Class B				3,910	59,694	0.1
					22,451,641	54.7
GELDMARKTINSTRUMENTE						
US-SCHATZWECHSEL						
U.S. Treasury Bill(b)	0.00%	06/11/2020	USD	11,396	11,395,105	27.8
U.S. Treasury Bill	0.00%	06/18/2020		996	995,941	2.4
U.S. Treasury Bill	0.00%	08/04/2020		15,500	15,496,280	37.8
U.S. Treasury Bill	0.00%	09/24/2020		3,023	3,021,458	7.4
U.S. Treasury Bill(b)	0.00%	10/22/2020		7,387	7,382,358	18.0
					38,291,142	93.4
					60,742,783	148.1
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
STAMMAKTIEN						
FINANZWERTE						
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN						
FGL Holdings (a) (c)				49,588	533,766	1.3
Gesamtanlagen						
(Kosten $60,533,081)					$ 61,276,549	149.4%
Termineinlagen						
Bank of Nova Scotia, Toronto(d)	0.04 %	–			165,008	0.4
BBH, Grand Cayman(d)	(0.60)%	–			4,529	0.0
BBH, Grand Cayman(d)	(0.25)%	–			2,428	0.0
BBH, Grand Cayman(d)	0.01 %	–			20,259	0.0
BBH, Grand Cayman(d)	0.03 %	–			3,621	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(d)	(1.39)%	–			462,869	1.1
DBS Bank Ltd, Singapore(d)	0.01 %	–			4,294,698	10.5
HSBC France S.A., Paris(d)	(0.67)%	–			841,034	2.1
SEB, Stockholm(d)	(0.30)%	–			23,018	0.1
Sumitomo, London(d)	(0.26)%	–			346,398	0.8
Termineinlagen insgesamt					6,163,862	15.0
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					(26,418,689)	(64.4)
Nettovermögen					$ 41,021,722	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
10 Yr Australian Bond Futures	06/15/2020	9	$ 892,864	$ 893,660	$ 796
Euro STOXX 50 Index Futures	06/19/2020	22	689,270	749,438	60,168
FTSE 100 Index Futures	06/19/2020	13	905,854	980,977	75,123
FTSE China A50 Futures	06/29/2020	4	52,342	52,936	594
FTSE/JSE Top 40 Futures	06/18/2020	9	190,684	239,096	48,412
Japan 10 Yr Bond (OSE) Futures	06/15/2020	5	7,077,195	7,056,424	(20,771)
MSCI Singapore IX ETS Futures	06/29/2020	92	1,897,821	1,881,473	(16,348)
SPI 200 Index Futures	06/18/2020	3	268,470	288,037	19,567
Short					
10 Yr Canadian Bond Futures	09/21/2020	20	2,233,097	2,231,761	1,336
Euro-Bund Futures	06/08/2020	18	3,448,060	3,445,906	2,154
Hang Seng Index Futures	06/29/2020	2	290,478	296,485	(6,007)
Long Gilt Futures	09/28/2020	7	1,187,564	1,188,169	(605)
Mini MSCI EAFE Futures	06/19/2020	22	1,633,045	1,898,160	(265,115)
MSCI Taiwan Index Futures	06/29/2020	7	285,790	288,345	(2,555)
OMXS 30 Index Futures	06/18/2020	31	516,260	539,348	(23,088)
S&P 500 E Mini Futures	06/19/2020	29	3,814,466	4,410,900	(596,434)
S&P/TSX 60 Index Futures	06/18/2020	4	503,449	532,055	(28,606)
SET 50 Futures	06/29/2020	16	84,926	89,997	(5,071)
SGX Nifty 50 Futures	06/25/2020	27	489,119	515,524	(26,405)
TOPIX Index Futures	06/11/2020	4	522,942	580,721	(57,779)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2020	2	277,227	278,125	(898)
					$ (841,532)
				Wertsteigerung	$ 208,150
				Wertminderung	$ (1,049,682)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC	CHF	1,606	USD	1,656	06/17/2020	$ (14,636)
Barclays Bank PLC	SEK	6,093	USD	632	06/17/2020	(14,238)
Barclays Bank PLC	USD	1,819	MXN	44,010	06/19/2020	160,954
Barclays Bank PLC	RUB	85,873	USD	1,194	07/14/2020	(17,048)
Barclays Bank PLC	INR	89,567	USD	1,176	07/23/2020	(3,965)
Barclays Bank PLC	USD	1,056	IDR	15,757,483	07/23/2020	9,554
Barclays Bank PLC	USD	787	INR	59,923	07/23/2020	2,550
Barclays Bank PLC	KRW	444,528	USD	363	08/13/2020	1,903
Barclays Bank PLC	PHP	1,852	USD	36	08/19/2020	(116)
Barclays Bank PLC	USD	2,667	PHP	135,955	08/19/2020	12,506
Barclays Bank PLC	USD	365	CNY	2,609	08/20/2020	(1,114)
Barclays Bank PLC	USD	304	CNY	2,184	08/20/2020	623
BNP Paribas SA	USD	1,304	BRL	7,013	06/02/2020	10,093
BNP Paribas SA	BRL	7,013	USD	1,302	07/02/2020	(10,037)
BNP Paribas SA	USD	354	INR	26,895	07/23/2020	284
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD	519	USD	308	06/04/2020	(14,063)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	48	JPY	5,227	06/05/2020	491
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	32	USD	19	06/11/2020	(2,354)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	259	USD	172	06/15/2020	(441)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	895	USD	637	06/15/2020	(12,901)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	369	USD	277	06/15/2020	8,607
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	96	USD	99	06/15/2020	(663)
Brown Brothers Harriman & Co.	DKK	617	USD	90	06/15/2020	(1,835)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	2,532	USD	2,757	06/15/2020	(54,101)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	1,609	USD	1,822	06/15/2020	35,117
Brown Brothers Harriman & Co.	HKD	504	USD	65	06/15/2020	(21)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	13,584	USD	126	06/15/2020	109
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK	1,902	USD	188	06/15/2020	(8,200)
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	1,626	USD	170	06/15/2020	(2,914)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	221	AUD	339	06/15/2020	5,039
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	352	CAD	484	06/15/2020	(528)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	1,052	CAD	1,480	06/15/2020	23,021
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	579	CHF	561	06/15/2020	4,320
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	31	DKK	208	06/15/2020	196
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	428	EUR	383	06/15/2020	(2,718)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	2,883	EUR	2,619	06/15/2020	24,799

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	398	GBP	324	06/152020	$ 2,143
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	65	HKD	504	06/152020	3
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	466	ILS	1,633	06/152020	(541)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	102	JPY	10,898	06/152020	(586)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	43	JPY	4,689	06/152020	20
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	117	NOK	1,151	06/152020	1,147
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	226	SEK	2,194	06/152020	7,215
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK	39,345	USD	3,890	06/172020	(157,883)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	311	AUD	473	06/172020	3,872
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	220	CAD	308	06/172020	3,959
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	2,374	CHF	2,305	06/172020	23,706
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	58	EUR	53	06/172020	673
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	9,811	USD	414	06/192020	(27,606)
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	3,565	USD	367	07/152020	(11,728)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	246	NOK	2,493	07/152020	10,724
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	194	GBP	158	07/172020	1,177
Brown Brothers Harriman & Co.	HUF	56,772	USD	175	07/292020	(6,771)
Brown Brothers Harriman & Co.	PLN	3,347	USD	806	07/292020	(28,402)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	502	HUF	158,823	07/292020	5,932
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	619	USD	446	08/062020	(3,452)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	418	CAD	575	08/062020	(312)
Brown Brothers Harriman & Co.	THB	45,898	USD	1,437	08/272020	(5,306)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	573	USD	593	08/282020	(4,397)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	687	USD	753	09/142020	(11,047)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	33,772	AUD	52,141	06/122020	983,126
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	26	GBP	21	06/122020	58
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,465	EUR	1,330	06/302020	12,570
Citibank, NA	USD	540	BRL	2,920	06/022020	6,905
Citibank, NA	GBP	445	USD	550	06/152020	255
Citibank, NA	ILS	2,442	USD	697	06/152020	1,023
Citibank, NA	CLP	2,948,663	USD	3,534	07/152020	(150,407)
Citibank, NA	COP	1,668,365	USD	445	07/152020	(220)
Citibank, NA	USD	1,960	CLP	1,600,971	07/152020	40,657
Citibank, NA	USD	444	COP	1,668,365	07/152020	1,465
Citibank, NA	USD	449	INR	35,116	07/232020	13,120
Citibank, NA	USD	558	TWD	16,389	08/202020	(7,822)
Credit Suisse International	NZD	4,389	USD	2,704	06/172020	(20,012)
Credit Suisse International	USD	5,129	NZD	8,529	06/172020	164,939
Credit Suisse International	USD	597	ZAR	10,426	07/172020	(5,549)
Credit Suisse International	USD	608	IDR	9,093,529	07/232020	6,816
Credit Suisse International	CZK	39,183	USD	1,573	07/292020	(43,824)
Deutsche Bank AG	PEN	5,227	USD	1,512	07/152020	(12,514)
Deutsche Bank AG	PEN	5,667	USD	1,656	07/152020	3,346
Deutsche Bank AG	USD	1,745	PEN	6,011	07/152020	8,138
Deutsche Bank AG	CNY	1,299	USD	182	08/202020	555
Goldman Sachs Bank USA	BRL	3,428	USD	601	06/022020	(41,832)
Goldman Sachs Bank USA	CAD	1,174	USD	852	06/152020	(1,038)
Goldman Sachs Bank USA	EUR	1,223	USD	1,375	06/152020	17,230
Goldman Sachs Bank USA	USD	906	CAD	1,249	06/172020	1,401
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,244	EUR	1,133	06/172020	13,810
Goldman Sachs Bank USA	USD	594	GBP	486	06/172020	6,181
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,234	NOK	12,228	06/172020	23,966
Goldman Sachs Bank USA	MXN	22,323	USD	996	06/192020	(8,111)
Goldman Sachs Bank USA	USD	664	MXN	14,832	06/192020	2,871
Goldman Sachs Bank USA	USD	656	BRL	3,509	07/022020	432
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,935	RUB	143,098	07/142020	83,703
Goldman Sachs Bank USA	ZAR	26,291	USD	1,501	07/172020	10,325
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,028	CZK	25,238	07/292020	13,118
Goldman Sachs Bank USA	PHP	186,253	USD	3,645	08/192020	(25,491)
HSBC Bank USA	BRL	6,505	USD	1,150	06/022020	(68,590)
HSBC Bank USA	KRW	518,838	USD	420	08/132020	(876)
HSBC Bank USA	USD	226	KRW	279,089	08/132020	530
JPMorgan Chase Bank, NA	AUD	5,966	USD	3,871	06/172020	(105,747)
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	1,133	USD	1,230	06/172020	(27,413)
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	1,194	USD	1,455	06/172020	(19,681)
JPMorgan Chase Bank, NA	JPY	269,005	USD	2,503	06/172020	8,521
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	2,210	JPY	238,194	06/172020	(955)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	3,641	SEK	35,632	06/172020	141,405
JPMorgan Chase Bank, NA	CLP	930,494	USD	1,136	07/152020	(26,758)
JPMorgan Chase Bank, NA	COP	2,862,000	USD	743	07/152020	(21,647)
JPMorgan Chase Bank, NA	COP	443,053	USD	118	07/152020	115
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	2,166	ZAR	40,072	07/172020	106,650
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR	17,299,734	USD	1,160	07/232020	(9,245)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	957	IDR	15,168,758	07/232020	67,827
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	983	INR	75,088	07/232020	6,383

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JPMorgan Chase Bank, NA	CZK	22,819	USD	898	07/292020	$ (43,408)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	518	PLN	2,157	07/292020	19,471
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	246	KRW	297,401	08/132020	(5,043)
JPMorgan Chase Bank, NA	TWD	17,198	USD	576	08/202020	(1,083)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	701	CNY	5,044	08/202020	3,537
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	633	TWD	18,752	08/202020	(3,994)
Royal Bank of Scotland PLC	CHF	712	USD	735	06/152020	(4,866)
Royal Bank of Scotland PLC	USD	718	COP	2,862,000	07/152020	46,007
Standard Chartered Bank	USD	1,091	THB	34,753	08/27/2020	730
						$ 1,101,873
					Wertsteigerung	$ 2,177,923
					Wertminderung	$ (1,076,050)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Kontrahent	Nomineller Betrag (000)	Abschlussdatum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 500	12/17/2028	2.779%	3 Month BKBM	$ (55,526)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 1,410	02/03/2030	(0.368)%	6 Month LIBOR	(1,842)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,410	02/03/2030	6 Month LIBOR	(0.368)%	(575)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	630	02/07/2030	(0.332)%	6 Month LIBOR	(843)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	630	02/07/2030	6 Month LIBOR	(0.332)%	2,042
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	170	03/03/2030	(0.537)%	6 Month LIBOR	(195)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,100	03/03/2030	6 Month LIBOR	(0.537)%	(20,153)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	500	03/12/2030	6 Month LIBOR	(0.576)%	(11,112)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 1,310	03/24/2030	1.290%	3 Month BKBM	2,210
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,310	03/24/2030	3 Month BKBM	1.290%	43,016
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 890	03/30/2030	6 Month LIBOR	(0.122)%	21,922
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 260	04/02/2030	0.900%	3 Month BKBM	417
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	260	04/02/2030	3 Month BKBM	0.900%	2,490
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	SEK 4,290	04/16/2030	0.476%	3 Month STIBOR	(262)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 1,740	04/16/2030	0.955%	3 Month BKBM	2,835
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,740	04/16/2030	3 Month BKBM	0.955%	22,193
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	SEK 14,090	04/16/2030	3 Month STIBOR	0.476%	15,467
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 730	04/16/2030	6 Month LIBOR	(0.219)%	10,265
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NOK 6,370	05/05/2030	0.885%	6 Month NIBOR	(732)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 1,930	05/05/2030	6 Month LIBOR	(0.335)%	3,014
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NOK 10,360	05/05/2030	6 Month NIBOR	0.885%	8,830
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 430	06/02/2030	0.718%	3 Month BKBM	821
Insgesamt					$ 44,282
				Wertsteigerung	$ 135,522
				Wertminderung	$ (91,240)

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeitsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation erhalten					
Credit Suisse International					
TPXDDVD	109,686	LIBOR Minus 0.10%	JPY 246,361	02/15/2021	$ (172,882)
JPMorgan Chase Bank, N.A.					
Equitrans Midstream Corp.	16,222	LIBOR Plus 0.40%	USD 326	08/14/2020	9,460
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Swiss Market Index Futures	50	0.00%	CHF 472	06/19/2020	(19,767)
Swiss Market Index Futures	50	0.00%	388	06/19/2020	(107,189)
Swiss Market Index Futures	10	0.00%	91	06/19/2020	(7,753)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Bank of America, N.A.					
MLABERP	52,481	0.01%	USD (5,222)	05/17/2021	(109,916)
MLABJPBB	929,175	0.20%	JPY (89,823)	02/15/2021	2,843
Barclays Bank PLC					
BCCFCTRP	4,664	0.35%	USD (1,714)	03/15/2021	45,321
BCCFHI2P	5,560	0.02%	(1,129)	10/15/2020	68,583
BCCFHI2P	6,213	0.02%	(1,262)	04/15/2021	76,638
Credit Suisse International					
CSABJPSS	276,319	LIBOR	JPY (243,039)	02/15/2021	198,979

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz		Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Goldman Sachs & Co.						
Charles Schwab Corp. (The)	(10,587)	LIBOR Minus 0.30%	USD	361	01/05/2021	$ 82,944
Charles Schwab Corp. (The)	(1,564)	LIBOR Minus 1.08%		51	01/05/2021	12,253
First Horizon National Corp.	(75,648)	LIBOR Minus 0.29%		1,089	01/05/2021	304,767
First Horizon National Corp.	(14,302)	LIBOR Minus 0.28%		237	01/05/2021	57,619
First Horizon National Corp.	(11,679)	LIBOR Minus 0.31%		192	01/05/2021	47,052
First Horizon National Corp.	(18,060)	LIBOR Minus 0.30%		159	01/05/2021	72,759
First Horizon National Corp.	(14,071)	LIBOR Minus 0.40%		102	01/05/2021	56,688
First Horizon National Corp.	(3,329)	LIBOR Minus 1.54%		56	01/05/2021	13,412
Goldman Sachs International						
GSISBT10	42,420	0.00%		(1,840)	01/15/2021	(10,181)
GSISET10	44,942	0.00%		(1,640)	01/15/2021	(74,643)
GSISET10	21,515	0.00%		(1,849)	06/15/2020	(168,812)
GSISFT10	13,631	0.00%		(1,573)	06/15/2020	(10,936)
GSISFT10	37,031	0.00%		(1,754)	01/15/2021	(134,099)
JPMorgan Chase Bank, N.A.						
BorgWarner, Inc.	(11,063)	LIBOR Minus 0.30%		238	08/14/2020	(30,410)
Equitrans Midstream Corp.	(32,469)	LIBOR Minus 0.30%		276	08/14/2020	(4,953)
Equitrans Midstream Corp.	(3,268)	LIBOR Minus 0.29%		27	08/14/2020	(499)
Equitrans Midstream Corp.	(2,540)	LIBOR Minus 0.92%		19	08/14/2020	(387)
Equitrans Midstream Corp.	(669)	LIBOR Minus 1.43%		5	08/14/2020	(102)
Equitrans Midstream Corp.	(490)	LIBOR Minus 0.42%		4	08/14/2020	(75)
Equitrans Midstream Corp.	(145)	LIBOR Minus 0.79%		1	08/14/2020	(22)
Independent Bank Group, Inc.	(1,169)	LIBOR Minus 0.30%		26	08/14/2020	(10,474)
JMABRG3C	5,673	0.15%		(1,250)	10/15/2020	(49,031)
JMABRG3C	9,622	0.15%		(2,120)	01/15/2021	(83,161)
Morgan Stanley	(4,731)	LIBOR Minus 0.30%		202	08/14/2020	27,193
Morgan Stanley	(2,544)	LIBOR Minus 0.32%		105	08/14/2020	14,622
Morgan Stanley	(1,461)	LIBOR Minus 0.31%		55	08/14/2020	8,398
NMC Health	850	LIBOR Plus 0.10%		8	03/10/2021	7,976
Peugeot SA	(9,756)	EURIBOR	EUR	128	08/14/2020	17,626
Peugeot SA	(9,593)	EURIBOR Minus 0.30%		106	08/14/2020	17,332
South State Corp.	(1,404)	LIBOR Minus 0.31%	USD	113	08/14/2020	27,457
South State Corp.	(1,020)	LIBOR Minus 0.30%		56	08/14/2020	19,948
South State Corp.	(181)	LIBOR Minus 0.29%		11	08/14/2020	3,540
Xperi Corp.	(19,242)	LIBOR Minus 0.30%		311	08/14/2020	57,618
Xperi Corp.	(78)	LIBOR Minus 1.58%		1	08/14/2020	234
Xperi Corp.	(8)	LIBOR Plus 0.18%		0	08/14/2020	24
Worldline SA	(2,760)	EURIBOR Minus 0.30%	EUR	172	08/14/2020	(2,845)
Worldline SA	(1,551)	EURIBOR Minus 0.20%		107	08/14/2020	(1,599)
Worldline SA	(365)	EURIBOR		23	08/14/2020	(376)
Morgan Stanley Capital Services LLC						
Aon PLC	(1,475)	LIBOR Minus 0.25%	USD	263	12/11/2020	(46,543)
Aon PLC	(606)	LIBOR Minus 1.10%		95	12/11/2020	(19,122)
Eldorado Resorts, Inc.	(2,775)	LIBOR Plus 0.30%		125	12/11/2020	27,810
Eldorado Resorts, Inc.	(339)	LIBOR Minus 0.58%		16	12/11/2020	3,397
Fidelity National Financial, Inc.	(1,871)	LIBOR Minus 0.30%		49	12/11/2020	(9,814)
Fidelity National Financial, Inc.	(1,788)	LIBOR Minus 0.29%		49	12/11/2020	(9,378)
Fidelity National Financial, Inc.	(1,402)	LIBOR Minus 0.25%		38	12/11/2020	(7,354)
Flutter Entertainment PLC	(8,472)	LIBOR Minus 0.30%	GBP	625	12/11/2020	(285,660)
Flutter Entertainment PLC	(4,231)	LIBOR Minus 0.88%		337	12/11/2020	(142,662)
Flutter Entertainment PLC	(1,568)	LIBOR Minus 0.75%		98	12/11/2020	(52,870)
IBOVESPA Futures	4	0.00%	BRL	(313)	06/17/2020	6,748
IBOVESPA Futures	19	0.00%		(1,534)	06/17/2020	22,961
KOSPI 200 Futures	750,000	0.00%	KRW	(185,027)	06/11/2020	12,292
Lantheus Holdings, Inc.	(11,245)	LIBOR Minus 0.29%	USD	152	12/11/2020	(17,471)
Lantheus Holdings, Inc.	(8,130)	LIBOR Minus 0.30%		90	12/11/2020	(12,631)
Lantheus Holdings, Inc.	(6,111)	LIBOR Minus 0.28%		68	12/11/2020	(9,495)
MSABETF2	7,701	0.11%		(780)	08/17/2020	10,487
MSABETF3	7,698	0.11%		(784)	08/17/2020	6,991
MSABETF4	7,473	0.11%		(758)	08/17/2020	4,962
MSABETF5	7,844	0.11%		(784)	08/17/2020	6,366
MSABETFR	3,406	0.11%		(345)	08/17/2020	5,305
MSABGSPO	46,679	0.14%		(4,553)	08/17/2020	46,805
MSCBVB3U	2,355	0.50%		(1,640)	05/17/2021	101,752
Insgesamt						$ (105,950)
					Wertsteigerung	$ 1,507,162
					Wertminderung	$ (1,613,112)
Swaps insgesamt						$ (61,668)

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

(b) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für ausstehende OTC-Derivate zu dienen.

(c) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

(d) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
BRL – Brazilian Real
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
CLP – Chilean Peso
CNY – Chinese Yuan Renminbi
COP – Colombian Peso
CZK – Czech Koruna
DKK – Danish Krone
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
HKD – Hong Kong Dollar
HUF – Hungarian Forint
IDR – Indonesian Rupiah
ILS – Israeli Shekel
INR – Indian Rupee
JPY – Japanese Yen
KRW – South Korean Won
MXN – Mexican Peso
NOK – Norwegian Krone
NZD – New Zealand Dollar
PEN – Peruvian Sol
PHP – Philippine Peso
PLN – Polish Zloty
RUB – Russian Ruble
SEK – Swedish Krona
THB – Thailand Baht
TWD – New Taiwan Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
BKBM – Bank Bill Benchmark (New Zealand)
CBT – Chicago Board of Trade
EAFE – Europe, Australia, and Far East
ETS – Emission Trading Scheme
EURIBOR – Euro Interbank Offered Rate
FTSE – Financial Times Stock Exchange
LCH – London Clearing House
LIBOR – London Interbank Offered Rate
MSCI – Morgan Stanley Capital International
NIBOR – Norwegian Interbank Offered Rate
OMXS – Stockholm Stock Exchange
OSE – Osaka Securities Exchange
SGX – Singapore Exchange
SPI – Share Price Index
STIBOR – Stockholm Interbank Offered Rate
TSX – Toronto Stock Exchange

	Anteile	Wert (EUR)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
ConvaTec Group PLC	2,743,710	€ 6,184,272	1.6%
Getinge AB - Class B	520,492	8,632,221	2.2
		14,816,493	3.8
PHARMAZEUTIKA			
GlaxoSmithKline PLC	721,600	13,407,977	3.4
Novo Nordisk A/S - Class B	192,479	11,265,673	2.8
Roche Holding AG	75,280	23,437,060	5.9
		48,110,710	12.1
		62,927,203	15.9
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	69,977	3,967,696	1.0
MTU Aero Engines AG	29,478	4,271,362	1.1
Saab AB - Class B (a)	397,583	8,626,030	2.2
		16,865,088	4.3
FLUGGESELLSCHAFTEN			
Wizz Air Holdings PLC	188,055	6,855,531	1.7
MASCHINEN			
Alstom SA	276,080	10,446,867	2.6
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Teleperformance	31,602	6,734,386	1.7
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
AerCap Holdings NV	272,250	7,890,808	2.0
Ashtead Group PLC	223,060	5,932,623	1.5
		13,823,431	3.5
		54,725,303	13.8
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of Ireland Group PLC	1,038,953	1,660,247	0.4
KBC Group NV	132,840	6,252,779	1.6
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	684,319	3,993,686	1.0
Norwegian Finans Holding ASA	684,690	4,375,801	1.1
		16,282,513	4.1
KAPITALMÄRKTE			
Euronext NV	100,327	8,317,108	2.1
IG Group Holdings PLC	938,979	7,983,617	2.0
Quilter PLC	2,272,096	3,270,234	0.8
TP ICAP PLC	833,760	3,150,666	0.8
		22,721,625	5.7
VERSICHERUNGEN			
Allianz SE (REG)	50,330	8,194,731	2.1
Zurich Insurance Group AG	20,940	6,064,682	1.5
		14,259,413	3.6
		53,263,551	13.4
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
EDP - Energias de Portugal SA	3,268,112	13,801,237	3.5
Enel SpA	1,916,201	13,223,703	3.3
		27,024,940	6.8
MEHRFACH-VERSORGUNGSBETRIEBE			
RWE AG	532,330	15,858,111	4.0
		42,883,051	10.8
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola European Partners PLC	201,790	6,839,109	1.7
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	388,680	8,865,791	2.3
Tesco PLC	4,676,890	11,867,123	3.0
		20,732,914	5.3

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (EUR)	Nettovermögen %
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Mowi ASA			164,620	€ 2,787,006	0.7%
Orkla ASA			444,746	3,592,616	0.9
Salmar ASA			86,370	3,492,437	0.9
				9,872,059	2.5
				37,444,082	9.5
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
Faurecia SE			212,910	7,379,461	1.9
KRAFTFAHRZEUGE					
Peugeot SA			386,645	4,950,989	1.2
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT					
GVC Holdings PLC			1,107,084	9,754,985	2.5
MULTILINE-EINZELHANDEL					
Next PLC			114,040	6,165,001	1.5
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER					
Pandora A/S			103,264	4,623,209	1.2
				32,873,645	8.3
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
Atos SE			118,730	8,052,269	2.0
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG					
ASM International NV (a)			65,710	6,869,980	1.7
NXP Semiconductors NV			62,760	5,422,067	1.4
				12,292,047	3.1
SOFTWARE					
Avast PLC			1,843,116	10,303,933	2.6
				30,648,249	7.7
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Aroundtown SA			1,707,033	8,436,157	2.1
CA Immobilien Anlagen AG			470,589	14,258,847	3.6
				22,695,004	5.7
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Akzo Nobel NV			111,785	8,227,376	2.1
Arkema SA			67,379	5,279,818	1.3
				13,507,194	3.4
METALL UND BERGBAU					
Boliden AB			284,313	5,541,613	1.4
				19,048,807	4.8
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Repsol SA			742,535	6,215,018	1.6
Royal Dutch Shell PLC - Class B			621,117	8,463,427	2.1
				14,678,445	3.7
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Eurazeo SE			144,833	6,343,686	1.6
Orange SA			410,850	4,455,668	1.1
				10,799,354	2.7
Gesamtanlagen					
(Kosten €402,799,638)				€381,986,694	96.3%
Termineinlagen					
BBH, Grand Cayman(b)	(0.60)%	–		37,664	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.01 %	–		186	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.39)%	–		37,014	0.0
HSBC France S.A., Paris(b)	(0.67)%	–		10,580,434	2.7
JPMorgan Chase, New York(b)	0.01 %	–		34,402	0.0
Nordea Bank Abp, Oslo(b)	(0.25)%	–		38,525	0.0
SEB, Stockholm(b)	(0.30)%	–		38,277	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	–		39,437	0.0
Termineinlagen insgesamt				10,805,939	2.7
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				3,938,987	1.0
Nettovermögen				€396,731,620	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Euro STOXX 50 Index Futures	06/19/2020	43	€ 1,075,685	€ 1,309,780	€ 234,095

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC Wholesale	EUR	1,144	GBP	998	08/14/2020	€ (36,454)
BNP Paribas SA	GBP	1,367	EUR	1,522	08/14/2020	5,161
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	1,005	SEK	10,708	08/14/2020	16,064
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	2,526	EUR	2,813	08/14/2020	9,315
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	3,903	EUR	358	08/14/2020	(14,223)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	5,542	AUD	9,262	06/12/2020	18,826
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	1,636	SGD	2,512	06/12/2020	(34,258)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	11,393	USD	12,352	06/12/2020	(267,232)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	505	HKD	4,313	06/30/2020	(4,309)
Citibank, NA NY	EUR	3,597	CHF	3,791	08/14/2020	(47,832)
Citibank, NA NY	EUR	2,041	GBP	1,777	08/14/2020	(68,681)
Citibank, NA NY	USD	4,621	EUR	4,268	08/14/2020	119,883
Deutsche Bank AG	CHF	2,546	EUR	2,422	08/14/2020	37,927
Goldman Sachs Capital Markets	EUR	1,652	CHF	1,744	08/14/2020	(18,837)
Goldman Sachs Capital Markets	EUR	991	GBP	882	08/14/2020	(11,581)
Goldman Sachs Capital Markets	SEK	14,638	EUR	1,337	08/14/2020	(59,143)
HSBC Bank USA	EUR	1,220	GBP	1,071	08/14/2020	(30,995)
JPMorgan Chase Bank	NOK	112,597	EUR	10,186	08/14/2020	(217,328)
Morgan Stanley & Co., Inc.	EUR	23,765	CHF	24,971	08/14/2020	(383,978)
Morgan Stanley & Co., Inc.	EUR	1,781	GBP	1,588	08/14/2020	(18,648)
Morgan Stanley & Co., Inc.	EUR	1,469	NOK	16,008	08/14/2020	9,610
Morgan Stanley & Co., Inc.	SEK	45,519	EUR	4,284	08/14/2020	(56,704)
Societe Generale	GBP	3,846	EUR	4,369	08/14/2020	99,572
State Street Bank & Trust Co.	EUR	2,700	CHF	2,853	08/14/2020	(29,063)
State Street Bank & Trust Co.	GBP	2,470	EUR	2,775	08/14/2020	33,627
UBS	EUR	1,108	CHF	1,164	08/14/2020	(18,509)
						€ (967,790)
					Wertsteigerung	€ 349,985
					Wertminderung	€ (1,317,775)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CHF – Swiss Franc
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
HKD – Hong Kong Dollar
NOK – Norwegian Krone
SEK – Swedish Krona
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

REG – Registered Shares

	Anteile	Wert (EUR)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of Ireland Group PLC	4,767,288	€ 7,618,126	0.6%
Erste Group Bank AG	754,731	14,917,258	1.2
KBC Group NV	570,827	26,868,827	2.2
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	2,500,461	14,592,691	1.2
		63,996,902	5.2
KAPITALMÄRKTE			
Euronext NV	329,609	27,324,586	2.2
VERSICHERUNGEN			
Allianz SE (REG)	248,232	40,417,134	3.3
ASR Nederland NV	651,275	16,086,493	1.3
Talanx AG	877,002	27,748,343	2.2
		84,251,970	6.8
		175,573,458	14.2
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	331,814	18,813,854	1.5
Leonardo SpA	1,832,168	10,260,141	0.9
MTU Aero Engines AG	162,781	23,586,967	1.9
		52,660,962	4.3
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
TKH Group NV	435,873	13,834,609	1.1
INDUSTRIEKONZERNE			
Rheinmetall AG	250,063	18,244,596	1.5
MASCHINEN			
Alstom SA	926,010	35,040,218	2.8
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Teleperformance	103,826	22,125,321	1.8
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
AerCap Holdings NV	1,094,988	31,736,785	2.6
		173,642,491	14.1
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
EDP - Energias de Portugal SA	11,622,576	49,082,139	4.0
Enel SpA	8,359,546	57,689,227	4.7
		106,771,366	8.7
MEHRFACH-VERSORGUNGSBETRIEBE			
RWE AG	1,777,680	52,957,087	4.3
		159,728,453	13.0
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola European Partners PLC	727,580	24,659,294	2.0
Pernod Ricard SA	302,124	42,327,573	3.4
		66,986,867	5.4
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	1,658,704	37,835,038	3.1
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Mowi ASA	683,490	11,571,441	1.0
Salmar ASA	337,640	13,652,733	1.1
		25,224,174	2.1
HAUSHALTSPRODUKTE			
Henkel AG & Co. KGaA	242,381	17,463,551	1.4
		147,509,630	12.0
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Koninklijke Philips NV	606,860	24,753,819	2.0
PHARMAZEUTIKA			
Sanofi	834,747	73,065,405	5.9
		97,819,224	7.9
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Akzo Nobel NV	343,250	25,263,200	2.1
Arkema SA	275,118	21,558,246	1.7

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (EUR)	Nettover-mögen %
Evonik Industries AG			877,560	€ 19,437,954	1.6%
				66,259,400	5.4
CONTAINER UND VERPACKUNGEN					
Smurfit Kappa Group PLC			1,044,451	30,622,394	2.5
				96,881,794	7.9
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
Atos SE			477,030	32,352,175	2.6
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG					
ASM International NV (a)			329,589	34,458,530	2.8
NXP Semiconductors NV			226,040	19,528,425	1.6
				53,986,955	4.4
				86,339,130	7.0
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Aroundtown SA			5,669,694	28,019,628	2.3
CA Immobilien Anlagen AG			667,951	20,238,915	1.6
Vonovia SE			600,695	31,103,987	2.5
				79,362,530	6.4
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Eurazeo SE			486,130	21,292,494	1.7
Masmovil Ibercom SA			1,338,930	25,064,770	2.0
Orange SA			1,663,000	18,035,235	1.5
				64,392,499	5.2
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Repsol SA			2,934,519	24,561,924	2.0
TOTAL SA			1,129,422	37,976,815	3.1
				62,538,739	5.1
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
Faurecia SE			711,600	24,664,056	2.0
KRAFTFAHRZEUGE					
Peugeot SA (a)			1,702,077	21,795,096	1.8
				46,459,152	3.8
Gesamtanlagen					
(Kosten €1,331,249,269)				€ 1,190,247,100	96.6%
Termineinlagen					
BBH, Grand Cayman(b)	0.01 %	–		105	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(b)	(0.67)%	–		27,131,154	2.2
Sumitomo, Tokyo(b)	0.01 %	–		50,601	0.0
Termineinlagen insgesamt				27,181,860	2.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				15,250,392	1.2
Nettovermögen				€ 1,232,679,352	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Euro STOXX 50 Index Futures	06/19/2020	218	€ 5,453,472	€ 6,640,280	€ 1,186,808

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC Wholesale	EUR	3,192	GBP	2,839	06/15/2020	€ (37,337)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	12,045	EUR	11,068	06/15/2020	242,019
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	2,415	AUD	4,037	06/12/2020	8,836
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	80	PLN	366	06/12/2020	1,800
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	69	SGD	105	06/12/2020	(1,382)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	55,926	USD	60,643	06/12/2020	(1,305,467)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JPMorgan Chase Bank	GBP	22,711	EUR	25,692	06/15/2020	€	455,589
JPMorgan Chase Bank	NOK	255,439	EUR	23,125	06/15/2020		(496,179)
						€	(1,132,121)
					Wertsteigerung	€	708,244
					Wertminderung	€	(1,840,365)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
NOK – Norwegian Krone
PLN – Polish Zloty
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

REG – Registered Shares

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONSAUSRÜSTUNG			
Arista Networks, Inc.	169,440	$ 39,557,462	0.8%
Motorola Solutions, Inc.	169,571	22,948,044	0.5
		62,505,506	1.3
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Amphenol Corp. - Class A	205,172	19,811,408	0.4
Cognex Corp.	289,410	16,421,124	0.3
IPG Photonics Corp.	168,058	26,116,213	0.6
		62,348,745	1.3
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Euronet Worldwide, Inc.	317,781	30,103,394	0.6
PayPal Holdings, Inc.	918,004	142,299,800	2.9
Visa, Inc. - Class A	1,085,434	211,920,134	4.4
		384,323,328	7.9
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV (ADR)	125,870	41,475,424	0.9
NVIDIA Corp.	141,463	50,222,194	1.0
QUALCOMM, Inc.	206,520	16,703,337	0.3
Texas Instruments, Inc.	128,040	15,203,470	0.3
Xilinx, Inc.	1,075,926	98,931,396	2.1
		222,535,821	4.6
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	207,200	80,103,520	1.7
ANSYS, Inc.	35,197	9,960,751	0.2
Microsoft Corp.	1,816,528	332,878,756	6.9
Paycom Software, Inc.	96,100	28,563,803	0.6
Slack Technologies, Inc. - Class A	841,128	29,481,536	0.6
Splunk, Inc.	97,092	18,043,577	0.4
Tyler Technologies, Inc.	106,537	39,984,402	0.8
		539,016,345	11.2
		1,270,729,745	26.3
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	147,663	90,489,363	1.9
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	554,727	159,739,187	3.3
		250,228,550	5.2
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
ABIOMED, Inc.	133,228	29,829,749	0.6
Align Technology, Inc.	211,230	51,882,313	1.1
Edwards Lifesciences Corp.	465,480	104,602,665	2.2
IDEXX Laboratories, Inc.	162,802	50,286,282	1.1
Intuitive Surgical, Inc.	261,032	151,406,391	3.1
Stryker Corp.	205,362	40,195,504	0.8
		428,202,904	8.9
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
UnitedHealth Group, Inc.	715,522	218,126,882	4.5
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Veeva Systems, Inc. - Class A	206,304	45,153,756	0.9
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Illumina, Inc.	221,460	80,401,053	1.6
Mettler-Toledo International, Inc.	23,038	18,315,210	0.4
		98,716,263	2.0
PHARMAZEUTIKA			
Zoetis, Inc.	1,185,874	165,298,977	3.4
		1,205,727,332	24.9
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	749,988	92,158,525	1.9
Take-Two Interactive Software, Inc.	62,530	8,514,710	0.2
		100,673,235	2.1
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	233,558	333,735,697	6.9
Facebook, Inc. - Class A	1,126,693	253,607,328	5.2
		587,343,025	12.1
		688,016,260	14.2

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT					
Domino's Pizza, Inc.			119,290	$ 46,026,854	0.9%
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB					
Amazon.com, Inc.			94,430	230,632,999	4.8
Booking Holdings, Inc.			10,670	17,492,611	0.4
Etsy, Inc.			207,923	16,837,605	0.3
				264,963,215	5.5
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL					
Burlington Stores, Inc.			251,204	52,669,943	1.1
Home Depot, Inc. (The)			448,633	111,476,328	2.3
TJX Cos., Inc. (The)			1,014,898	53,546,018	1.1
Ulta Beauty, Inc.			128,972	31,470,458	0.7
				249,162,747	5.2
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER					
NIKE, Inc. - Class B			1,108,506	109,276,521	2.3
				669,429,337	13.9
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Monster Beverage Corp.			2,546,842	183,143,408	3.8
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Costco Wholesale Corp.			245,452	75,714,579	1.6
				258,857,987	5.4
INDUSTRIEGÜTER					
BAUPRODUKTE					
Allegion PLC			579,452	57,771,364	1.2
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF					
Copart, Inc.			392,651	35,099,073	0.7
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG					
AMETEK, Inc.			215,700	19,781,847	0.4
INDUSTRIEKONZERNE					
Roper Technologies, Inc.			200,171	78,827,340	1.7
MASCHINEN					
IDEX Corp.			100,093	15,951,822	0.3
				207,431,446	4.3
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Sherwin-Williams Co. (The)			140,908	83,678,216	1.7
FINANZWERTE					
KAPITALMÄRKTE					
S&P Global, Inc.			56,800	18,461,136	0.4
Gesamtanlagen					
(Kosten $3,143,212,053)				$ 4,402,331,459	91.1%
Termineinlagen					
Barclays, London(a)	0.01%	–		444,270,188	9.2
BBH, Grand Cayman(a)	(0.67)%	–		8,552	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	2.75%	–		193,050	0.0
National Australia Bank, London(a)	0.01%	–		428,545	0.0
Termineinlagen insgesamt				444,900,335	9.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(15,060,225)	(0.3)
Nettovermögen				$ 4,832,171,569	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	60,593	AUD	93,425	06/12/2020	$ 1,680,302
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	182,699	EUR	168,512	06/12/2020	4,392,813
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,006	GBP	817	06/12/2020	2,449
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6,334	PLN	26,607	06/12/2020	298,714
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	431	SGD	611	06/12/2020	1,205
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	12,468	ZAR	216,493	06/12/2020	(146,716)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	175	CNH	1,248	06/22/2020	(860)
						$ 6,227,907
					Wertsteigerung	$ 6,375,483
					Wertminderung	$ (147,576)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
BT Group PLC	700,340	$ 1,005,469	0.1%
CenturyLink, Inc.	114,542	1,125,948	0.1
Comcast Corp. - Class A	48,640	1,926,144	0.1
Eutelsat Communications SA	100,096	995,560	0.1
HKT Trust & HKT Ltd. - Class SS	1,175,000	1,670,451	0.1
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	87,300	1,978,406	0.2
Spark New Zealand Ltd.	413,961	1,135,791	0.1
Telenor ASA	50,119	759,976	0.1
Verizon Communications, Inc.	31,014	1,779,583	0.1
		12,377,328	1.0
UNTERHALTUNG			
Netflix, Inc.	4,140	1,737,682	0.2
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class A	234	335,444	0.0
Alphabet, Inc. - Class C	1,688	2,412,018	0.2
Auto Trader Group PLC	401,050	2,764,746	0.2
Facebook, Inc. - Class A	20,012	4,504,501	0.4
Z Holdings Corp.	305,700	1,247,234	0.1
		11,263,943	0.9
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
NTT DOCOMO, Inc.	13,000	355,784	0.0
		25,734,737	2.1
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	135,812	2,328,315	0.2
Domino's Pizza, Inc.	2,950	1,138,228	0.1
McDonald's Corp.	13,290	2,476,193	0.2
		5,942,736	0.5
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Persimmon PLC	5,608	158,810	0.0
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Amazon.com, Inc.	1,868	4,562,347	0.4
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Dollar General Corp.	18,160	3,477,821	0.3
Kohl's Corp.	70,530	1,355,587	0.1
		4,833,408	0.4
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	2,428	2,787,004	0.2
Home Depot, Inc. (The)	14,973	3,720,491	0.3
Ross Stores, Inc.	14,530	1,408,829	0.1
TJX Cos., Inc. (The)	17,850	941,766	0.1
		8,858,090	0.7
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
adidas AG	6,830	1,798,366	0.1
Deckers Outdoor Corp.	11,110	2,027,908	0.2
Pandora A/S	33,617	1,670,550	0.1
		5,496,824	0.4
		29,852,215	2.4
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
PepsiCo, Inc.	15,740	2,070,597	0.2
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Coles Group Ltd.	109,650	1,122,619	0.1
Costco Wholesale Corp.	5,075	1,565,485	0.1
Koninklijke Ahold Delhaize NV	123,653	3,130,924	0.3
Walmart, Inc.	30,920	3,835,935	0.3
		9,654,963	0.8
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Hershey Co. (The)	6,050	820,864	0.1
Morinaga & Co., Ltd./Japan	32,900	1,410,937	0.1
Nestle SA	23,038	2,487,759	0.1
Salmar ASA	55,615	2,501,338	0.2
WH Group Ltd.	1,106,500	953,547	0.1
		8,174,445	0.6

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
HAUSHALTSPRODUKTE			
Clorox Co. (The)	1,400	$ 288,750	0.0%
Kimberly-Clark Corp.	8,780	1,241,843	0.1
Procter & Gamble Co. (The)	27,030	3,133,318	0.3
		4,663,911	0.4
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Unilever NV	20,113	1,037,956	0.1
Unilever PLC	4,770	255,196	0.0
		1,293,152	0.1
TABAK			
Altria Group, Inc.	35,232	1,375,810	0.1
British American Tobacco PLC	41,780	1,645,728	0.1
Imperial Brands PLC	60,107	1,088,614	0.1
Philip Morris International, Inc.	36,020	2,642,427	0.2
Swedish Match AB	47,370	3,285,844	0.3
		10,038,423	0.8
		35,895,491	2.9
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE			
Tervita Corp.	173	471	0.0
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Royal Dutch Shell PLC - Class B	109,740	1,661,585	0.1
		1,662,056	0.1
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	418,780	2,211,073	0.2
Comerica, Inc.	35,880	1,304,238	0.1
DBS Group Holdings Ltd.	63,500	875,103	0.1
JPMorgan Chase & Co.	9,040	879,683	0.1
KBC Group NV	25,147	1,313,932	0.1
Royal Bank of Canada	45,105	2,926,411	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB - Class A	163,450	1,417,571	0.1
Swedbank AB - Class A	43,906	549,841	0.0
Westpac Banking Corp.	88,983	1,021,346	0.1
		12,499,198	1.0
KAPITALMÄRKTE			
CME Group, Inc. - Class A	10,030	1,831,478	0.1
FactSet Research Systems, Inc.	4,090	1,257,716	0.1
IGM Financial, Inc.	29,321	696,370	0.1
Invesco Ltd.	8,632	68,797	0.0
Moody's Corp.	5,099	1,363,523	0.1
Partners Group Holding AG	2,616	2,160,689	0.2
S&P Global, Inc.	11,855	3,853,112	0.3
Singapore Exchange Ltd.	153,600	900,204	0.0
Standard Life Aberdeen PLC	238,060	759,412	0.1
		12,891,301	1.0
VERSICHERUNGEN			
Admiral Group PLC	57,002	1,642,373	0.1
American Financial Group, Inc./OH	21,125	1,272,570	0.1
Legal & General Group PLC	257,747	631,860	0.1
Progressive Corp. (The)	13,220	1,026,930	0.1
Reinsurance Group of America, Inc. - Class A	4,075	369,806	0.0
RenaissanceRe Holdings Ltd.	10,420	1,749,101	0.1
Sampo Oyj - Class A	54,850	1,955,666	0.1
Swiss Re AG	576	38,999	0.0
Zurich Insurance Group AG	2,690	865,622	0.1
		9,552,927	0.7
HYPOTHEKEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
AGNC Investment Corp.	90,238	1,167,680	0.1
Annaly Capital Management, Inc.	183,709	1,131,647	0.1
		2,299,327	0.2
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG			
Essent Group Ltd.	26,080	861,944	0.1
		38,104,697	3.0
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Amgen, Inc.	6,848	1,572,985	0.1
Gilead Sciences, Inc.	17,819	1,386,853	0.1
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	4,930	1,419,643	0.1
		4,379,481	0.3

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Coloplast A/S - Class B	7,390	$ 1,238,059	0.1%
Edwards Lifesciences Corp.	2,256	506,968	0.0
		1,745,027	0.1
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Anthem, Inc.	5,860	1,723,485	0.1
Galenica AG	22,420	1,655,043	0.1
UnitedHealth Group, Inc.	17,763	5,415,050	0.5
		8,793,578	0.7
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Cerner Corp.	12,582	917,228	0.1
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Sartorius Stedim Biotech	4,640	1,255,724	0.1
PHARMAZEUTIKA			
Astellas Pharma, Inc.	128,700	2,284,725	0.2
Bristol-Myers Squibb Co.	54,658	3,264,176	0.2
Eli Lilly & Co.	10,000	1,529,500	0.1
GlaxoSmithKline PLC	185,110	3,821,916	0.3
Johnson & Johnson	31,581	4,697,674	0.4
Merck & Co., Inc.	66,354	5,356,094	0.4
Novo Nordisk A/S - Class B	73,530	4,776,879	0.4
Pfizer, Inc.	17,780	679,018	0.1
Roche Holding AG	20,062	6,939,725	0.6
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	36,600	1,422,325	0.1
		34,772,032	2.8
		51,863,070	4.1
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
L3Harris Technologies, Inc.	17,238	3,438,119	0.3
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
CH Robinson Worldwide, Inc.	31,320	2,540,991	0.2
SG Holdings Co., Ltd.	28,200	919,125	0.1
		3,460,116	0.3
FLUGGESELLSCHAFTEN			
Qantas Airways Ltd.	506,758	1,347,740	0.1
BAUPRODUKTE			
LIXIL Group Corp.	95,900	1,337,416	0.1
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Obayashi Corp.	46,000	425,259	0.0
MASCHINEN			
Atlas Copco AB - Class B	35,370	1,246,999	0.1
Cummins, Inc.	4,636	786,266	0.0
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	38,800	1,002,875	0.1
		3,036,140	0.2
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Experian PLC	70,130	2,436,355	0.2
Intertrust NV	58,210	918,840	0.1
RELX PLC	183,840	4,242,648	0.4
Verisk Analytics, Inc. - Class A	9,280	1,602,470	0.1
Wolters Kluwer NV	34,720	2,762,614	0.2
		11,962,927	1.0
STRASSE UND SCHIENE			
Nippon Express Co., Ltd.	9,800	503,426	0.0
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Fastenal Co.	18,540	764,960	0.1
		26,276,103	2.1
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Amadeus IT Group SA - Class A	20,690	1,078,068	0.1
Automatic Data Processing, Inc.	25,500	3,735,495	0.3
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	29,700	2,368,872	0.2
Capgemini SE	13,180	1,347,465	0.1
Fidelity National Information Services, Inc.	20,140	2,796,036	0.2
GMO Payment Gateway, Inc.	800	89,981	0.0
International Business Machines Corp.	12,227	1,527,152	0.1
Mastercard, Inc. - Class A	11,697	3,519,511	0.3
Paychex, Inc.	21,170	1,530,168	0.1
		17,992,748	1.4

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV	4,361	$ 1,418,150	0.1%
Intel Corp.	33,665	2,118,538	0.2
KLA Corp.	7,354	1,294,010	0.1
Lam Research Corp.	4,484	1,227,136	0.1
NVIDIA Corp.	5,869	2,083,612	0.2
QUALCOMM, Inc.	18,546	1,500,001	0.1
Texas Instruments, Inc.	33,107	3,931,125	0.3
		13,572,572	1.1
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	4,945	1,911,737	0.2
Avaya Holdings Corp.	915	13,359	0.0
Check Point Software Technologies Ltd.	24,211	2,655,220	0.2
Citrix Systems, Inc.	32,220	4,772,426	0.4
Constellation Software, Inc./Canada	3,230	3,671,693	0.3
Microsoft Corp.	73,145	13,403,821	1.1
Nice Ltd.	11,924	2,151,176	0.2
NortonLifeLock, Inc.	24,222	551,777	0.0
Oracle Corp.	101,300	5,446,901	0.4
Oracle Corp. Japan	28,400	3,312,829	0.3
Paycom Software, Inc.	4,499	1,337,238	0.1
ServiceNow, Inc.	4,272	1,657,237	0.1
		40,885,414	3.3
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	33,559	10,669,749	0.8
Seagate Technology PLC	22,079	1,171,070	0.1
		11,840,819	0.9
		84,291,553	6.7
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Chr Hansen Holding A/S	13,020	1,258,733	0.1
LyondellBasell Industries NV - Class A	23,341	1,488,222	0.1
Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	193,100	1,135,735	0.1
		3,882,690	0.3
METALL UND BERGBAU			
BHP Group Ltd.	66,843	1,543,358	0.1
BHP Group PLC	37,910	740,300	0.1
Evraz PLC	365,615	1,275,133	0.1
Fortescue Metals Group Ltd.	157,019	1,454,788	0.1
		5,013,579	0.4
		8,896,269	0.7
IMMOBILIEN			
REITS – DIVERSIFIZIERT			
Armada Hoffler Properties, Inc.	37,110	319,888	0.0
Essential Properties Realty Trust, Inc.	19,460	265,434	0.0
Fibra Uno Administracion SA de CV	221,170	169,659	0.0
Growthpoint Properties Ltd.	177,790	126,414	0.0
Hulic Reit, Inc.	340	436,960	0.1
ICADE	7,650	546,453	0.1
Kenedix Office Investment Corp. - Class A	19	105,355	0.0
Merlin Properties Socimi SA	36,270	303,974	0.0
Mirvac Group	287,540	450,401	0.1
NIPPON REIT Investment Corp.	60	210,580	0.0
One Liberty Properties, Inc.	15,360	243,456	0.0
Stockland	149,210	355,058	0.0
United Urban Investment Corp.	193	204,373	0.0
		3,738,005	0.3
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
American Tower Corp.	4,510	1,164,347	0.1
H&R Real Estate Investment Trust	167,290	1,178,569	0.1
Iron Mountain, Inc.	44,981	1,158,711	0.1
Kimco Realty Corp.	176,744	1,963,626	0.1
Klepierre SA	79,826	1,509,929	0.1
Nippon Building Fund, Inc.	363	2,275,377	0.2
Omega Healthcare Investors, Inc.	69,395	2,160,960	0.2
RioCan Real Estate Investment Trust	20,195	213,559	0.0
Simon Property Group, Inc.	21,630	1,248,051	0.1
VEREIT, Inc.	144,678	792,835	0.1
VICI Properties, Inc.	71,120	1,395,374	0.1
Vornado Realty Trust	14,390	521,062	0.0
		15,582,400	1.2

	Anteile	Wert (USD)	Nettover-mögen %
REITS – GESUNDHEITSWESEN			
Assura PLC	445,390	$ 434,545	0.0%
Healthpeak Properties, Inc.	35,670	878,909	0.1
Medical Properties Trust, Inc.	66,710	1,206,117	0.1
New Senior Investment Group, Inc.	76,970	223,213	0.0
Physicians Realty Trust	32,090	554,194	0.1
		3,296,978	0.3
REITS – HOTELS UND RESORTS			
Japan Hotel REIT Investment Corp.	215	89,413	0.0
Park Hotels & Resorts, Inc.	39,685	390,104	0.1
RLJ Lodging Trust	28,000	288,680	0.0
		768,197	0.1
REITS – INDUSTRIE			
Americold Realty Trust	32,490	1,160,218	0.1
Ascendas Real Estate Investment Trust	221,200	490,059	0.0
ESR-REIT	661,993	175,713	0.0
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	193	316,223	0.0
Industrial Logistics Properties Trust	31,230	585,563	0.1
Nippon Prologis REIT, Inc.	74	208,596	0.0
Rexford Industrial Realty, Inc.	7,670	305,266	0.0
STAG Industrial, Inc.	24,470	658,243	0.1
		3,899,881	0.3
REITS – BÜROS			
Allied Properties Real Estate Investment Trust	2,700	78,440	0.0
Befimmo SA	5,570	230,625	0.0
Cousins Properties, Inc.	8,010	249,271	0.0
Dexus	17,740	106,421	0.0
Easterly Government Properties, Inc.	15,030	376,802	0.1
Mori Trust Sogo Reit, Inc.	218	272,690	0.0
True North Commercial Real Estate Investment Trust	11,540	45,763	0.0
		1,360,012	0.1
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Vonovia SE	40,980	2,355,464	0.2
IMMOBILIEN-DIENSTLEISTUNGEN			
Unibail-Rodamco-Westfield	1,528	80,907	0.0
REITS – WOHNRAUM			
American Campus Communities, Inc.	17,050	550,715	0.1
American Homes 4 Rent - Class A	14,930	376,833	0.0
Bluerock Residential Growth REIT, Inc.	10,280	66,100	0.0
Camden Property Trust	2,630	240,829	0.0
Comforia Residential REIT, Inc.	30	90,686	0.0
Independence Realty Trust, Inc.	97,780	967,044	0.1
Japan Rental Housing Investments, Inc.	154	141,227	0.0
Killam Apartment Real Estate Investment Trust	19,840	243,812	0.0
Mid-America Apartment Communities, Inc.	2,780	323,481	0.0
Sun Communities, Inc.	5,860	803,934	0.1
		3,804,661	0.3
REITS – EINZELHANDEL			
Brixmor Property Group, Inc.	92,323	1,030,325	0.1
Charter Hall Retail REIT	81,307	177,218	0.0
Eurocommercial Properties NV	27,518	348,839	0.0
Immobiliare Grande Distribuzione SIIQ SpA	67,290	242,386	0.0
Kenedix Retail REIT Corp.	112	208,121	0.0
Mercialys SA	26,620	215,268	0.0
Shopping Centres Australasia Property Group	80,600	125,714	0.0
Vicinity Centres	672,160	721,326	0.1
		3,069,197	0.2
REITS – SPEZIALISIERT			
Digital Realty Trust, Inc.	6,890	989,128	0.1
Gaming and Leisure Properties, Inc.	36,228	1,251,315	0.1
MGM Growth Properties LLC - Class A	42,110	1,167,710	0.1
National Storage Affiliates Trust	8,270	248,183	0.0
		3,656,336	0.3
		41,612,038	3.3

	Zinssatz	Datum		Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
VERSORGUNG						
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE						
American Electric Power Co., Inc.				36,370	$ 3,100,542	0.2%
EDP - Energias de Portugal SA				309,280	1,449,825	0.1
Endesa SA				48,987	1,160,971	0.1
Enel SpA				508,177	3,892,867	0.3
NextEra Energy, Inc.				7,640	1,952,478	0.2
PPL Corp.				29,495	824,090	0.1
Red Electrica Corp. SA				66,130	1,162,776	0.1
SSE PLC				74,240	1,138,287	0.1
Terna Rete Elettrica Nazionale SpA				75,860	511,145	0.0
					15,192,981	1.2
GASVERSORGUNGSBETRIEBE						
AltaGas Ltd.				18,515	198,752	0.0
Snam SpA				264,970	1,230,640	0.1
Tokyo Gas Co., Ltd.				48,700	1,160,771	0.1
					2,590,163	0.2
MEHRFACH-VERSORGUNGSBETRIEBE						
AGL Energy Ltd.				5,107	57,052	0.0
Ameren Corp.				29,410	2,197,810	0.2
					2,254,862	0.2
					20,038,006	1.6
					364,226,235	29.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Alliance Data Systems Corp.	4.75%	12/15/2024	USD	833	745,415	0.1
Ally Financial, Inc.	5.75%	11/20/2025		440	461,950	0.0
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(a)	5.88%	05/24/2022	EUR	1,000	1,073,982	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(a)	5.88%	09/24/2023		200	213,381	0.0
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(a)	6.50%	03/05/2025	USD	200	190,189	0.0
Banco Santander SA(a)	6.75%	04/25/2022	EUR	600	679,030	0.1
CaixaBank SA(a)	6.75%	06/13/2024		1,400	1,531,620	0.1
Citizens Financial Group, Inc., Series B(a)	6.00%	07/06/2023	USD	50	43,893	0.0
Credit Suisse Group AG(a)	7.25%	09/12/2025		1,000	1,025,249	0.1
Societe Generale SA(a)	8.00%	09/29/2025		791	850,317	0.1
UniCredit SpA(a)	9.25%	06/03/2022	EUR	230	276,768	0.0
					7,091,794	0.6
MAKLER						
LPL Holdings, Inc.	5.75%	09/15/2025	USD	555	579,035	0.0
NFP Corp.	6.88%	07/15/2025		980	944,965	0.1
NFP Corp.	7.00%	05/15/2025		253	262,158	0.0
					1,786,158	0.1
FINANZEN						
CNG Holdings, Inc.	12.50%	06/15/2024		87	76,205	0.0
Curo Group Holdings Corp.	8.25%	09/01/2025		184	146,234	0.0
goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024		1,150	1,082,643	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	6.25%	06/03/2026		543	491,816	0.1
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR	100	100,906	0.0
Navient Corp.	5.50%	01/25/2023	USD	219	208,632	0.0
Navient Corp.	6.50%	06/15/2022		326	320,311	0.0
Navient Corp.	7.25%	09/25/2023		12	11,587	0.0
SLM Corp.	5.13%	04/05/2022		20	19,708	0.0
TMX Finance LLC/TitleMax Finance Corp.	11.13%	04/01/2023		122	97,465	0.0
					2,555,507	0.2
VERSICHERUNGEN						
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	7.00%	11/15/2025		635	603,155	0.1
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	8.13%	02/15/2024		1,124	1,196,170	0.1
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	10.13%	08/01/2026		159	166,045	0.0
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer	6.75%	10/15/2027		1,719	1,759,685	0.1
Genworth Holdings, Inc.	7.63%	09/24/2021		40	36,860	0.0
HUB International Ltd.	7.00%	05/01/2026		960	985,373	0.1
Polaris Intermediate Corp.(b)	8.50%	12/01/2022		256	224,618	0.0
					4,971,906	0.4
SONSTIGE FINANZWERTE						
Altice France Holding SA	10.50%	05/15/2027		390	434,104	0.0
Intrum AB	3.50%	07/15/2026	EUR	369	350,605	0.0
Tempo Acquisition LLC/Tempo Acquisition Finance Corp.	6.75%	06/01/2025	USD	516	515,984	0.1
					1,300,693	0.1

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
REITS								
	Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	USD	1,920	$	1,459,031	0.1%
	Diversified Healthcare Trust	4.75%	02/15/2028		1,380		1,147,236	0.1
	Diversified Healthcare Trust	6.75%	12/15/2021		50		48,530	0.0
	Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025		531		540,080	0.1
	GEO Group, Inc. (The)	6.00%	04/15/2026		3		2,349	0.0
	Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029		645		648,629	0.1
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.63%	05/01/2024		1,308		1,366,450	0.1
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.75%	02/01/2027		68		71,330	0.0
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	9.38%	04/01/2027		1,805		1,568,585	0.1
	Service Properties Trust	4.35%	10/01/2024		200		176,000	0.0
	Service Properties Trust	4.75%	10/01/2026		100		82,710	0.0
							7,110,930	0.6
							24,816,988	2.0
INDUSTRIE								
GRUNDSTOFFE								
	Alcoa Nederland Holding BV	6.13%	05/15/2028		1,550		1,516,454	0.1
	Arconic Corp.	6.13%	02/15/2028		1,282		1,246,331	0.1
	Ashland LLC	6.88%	05/15/2043		40		45,070	0.0
	Berry Global, Inc.	5.13%	07/15/2023		18		18,293	0.0
	CF Industries, Inc.	3.45%	06/01/2023		500		504,072	0.0
	CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043		780		824,557	0.1
	CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044		25		27,098	0.0
	Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026		61		55,649	0.0
	Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025		656		683,273	0.1
	Constellium SE	5.88%	02/15/2026		950		957,574	0.1
	Eldorado Gold Corp.	9.50%	06/01/2024		495		524,190	0.0
	FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027		697		702,345	0.1
	FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.75%	05/15/2022		990		1,005,487	0.1
	Freeport-McMoRan, Inc.	4.55%	11/14/2024		270		274,422	0.0
	Freeport-McMoRan, Inc.	5.00%	09/01/2027		125		126,971	0.0
	Freeport-McMoRan, Inc.	5.25%	09/01/2029		125		128,518	0.0
	Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034		22		21,812	0.0
	Freeport-McMoRan, Inc.	5.45%	03/15/2043		207		205,073	0.0
	Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.	7.38%	12/15/2023		441		441,528	0.0
	Hecla Mining Co.	7.25%	02/15/2028		642		651,691	0.1
	Joseph T Ryerson & Son, Inc.	11.00%	05/15/2022		261		258,951	0.0
	Kaiser Aluminum Corp.	6.50%	05/01/2025		140		143,523	0.0
	Novelis Corp.	5.88%	09/30/2026		725		743,193	0.1
	OCI NV	5.25%	11/01/2024		738		722,993	0.1
	Olin Corp.	5.13%	09/15/2027		400		358,924	0.0
	Olin Corp.	5.63%	08/01/2029		874		789,714	0.1
	Olin Corp.	9.50%	06/01/2025		207		225,913	0.0
	Peabody Energy Corp.	6.00%	03/31/2022		11		7,552	0.0
	PolyOne Corp.	5.75%	05/15/2025		202		211,668	0.0
	Reynolds Group Issuer, Inc./Reynolds Group Issuer LLC/ Reynolds Group Issuer Lu	7.00%	07/15/2024		7		7,068	0.0
	Sealed Air Corp.	6.88%	07/15/2033		26		30,701	0.0
	Smurfit Kappa Treasury Funding DAC	7.50%	11/20/2025		30		35,445	0.0
	SPCM SA	4.88%	09/15/2025		980		1,008,792	0.1
	Starfruit Finco BV/Starfruit US Holdco LLC	8.00%	10/01/2026		1,440		1,493,364	0.1
	United States Steel Corp.	12.00%	06/01/2025		1,019		1,022,078	0.1
	Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030		962		959,260	0.1
	WR Grace & Co.-Conn	5.13%	10/01/2021		480		493,345	0.0
							18,472,892	1.5
INVESTITIONSGÜTER								
	ARD Finance SA(b)	5.00%	06/30/2027	EUR	225		236,024	0.0
	ARD Finance SA(b)	6.50%	06/30/2027	USD	959		942,466	0.1
	Ardagh Packaging Finance PLC / Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	08/15/2027		710		697,575	0.1
	Bombardier, Inc.	5.75%	03/15/2022		37		24,600	0.0
	Bombardier, Inc.	6.00%	10/15/2022		215		140,157	0.0
	Bombardier, Inc.	6.13%	01/15/2023		626		383,978	0.0
	Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024		419		256,807	0.0
	Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025		475		288,579	0.0
	Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027		150		88,907	0.0
	Clean Harbors, Inc.	4.88%	07/15/2027		1,183		1,224,548	0.1
	Cleaver-Brooks, Inc.	7.88%	03/01/2023		349		294,027	0.0
	Colfax Corp.	6.00%	02/15/2024		235		246,127	0.0
	Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026		16		16,833	0.0
	Covanta Holding Corp.	5.88%	03/01/2024		100		99,559	0.0
	EnerSys	4.38%	12/15/2027		260		253,819	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	USD 1,730	$ 1,267,215	0.1%
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026	2,069	2,017,275	0.2
GFL Environmental, Inc.	5.13%	12/15/2026	710	741,558	0.1
GFL Environmental, Inc.	7.00%	06/01/2026	418	441,903	0.0
GFL Environmental, Inc.	8.50%	05/01/2027	433	478,352	0.0
Granite US Holdings Corp.	11.00%	10/01/2027	100	94,982	0.0
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	891	881,633	0.1
Harsco Corp.	5.75%	07/31/2027	434	425,797	0.0
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	5	4,781	0.0
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	5.50%	04/15/2024	325	324,746	0.0
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	7.25%	04/15/2025	1,016	920,785	0.1
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	789	755,101	0.1
RBS Global, Inc./Rexnord LLC.	4.88%	12/15/2025	485	485,030	0.0
Signature Aviation US Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2028	710	629,752	0.1
SPX FLOW, Inc.	5.88%	08/15/2026	512	517,251	0.1
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026	205	212,018	0.0
Terex Corp.	5.63%	02/01/2025	685	637,142	0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	826	707,932	0.1
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025	524	348,746	0.0
Trivium Packaging Finance BV	5.50%	08/15/2026	470	493,269	0.0
Trivium Packaging Finance BV	8.50%	08/15/2027	640	674,018	0.1
				18,253,292	1.5
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Altice Financing SA	7.50%	05/15/2026	986	1,037,612	0.1
Banijay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025	EUR 156	166,614	0.0
Cablevision Systems Corp.	5.88%	09/15/2022	USD 460	485,556	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.50%	05/01/2026	250	264,058	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.75%	02/15/2026	230	239,496	0.0
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	159	159,000	0.0
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	440	488,468	0.1
Diamond Sports Group LLC/Diamond Sports Finance Co.	5.38%	08/15/2026	408	323,881	0.0
DISH DBS Corp.	5.00%	03/15/2023	61	60,772	0.0
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	90	88,947	0.0
DISH DBS Corp.	6.75%	06/01/2021	40	40,815	0.0
DISH Network Corp.	3.38%	08/15/2026	473	413,076	0.0
Gray Television, Inc.	5.88%	07/15/2026	36	37,241	0.0
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	240	230,664	0.0
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	89	87,245	0.0
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	468	491,928	0.1
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027	15	14,341	0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	83	85,224	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	958	976,176	0.1
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026	2,189	2,026,979	0.2
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	200	120,371	0.0
Netflix, Inc.	5.88%	11/15/2028	95	108,168	0.0
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	4.63%	03/15/2030	622	573,375	0.1
Radiate Holdco LLC/Radiate Finance, Inc.	6.88%	02/15/2023	23	23,439	0.0
RR Donnelley & Sons Co.	7.88%	03/15/2021	6	5,975	0.0
Scripps Escrow, Inc.	5.88%	07/15/2027	78	72,532	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	863	798,356	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.88%	03/15/2026	226	221,251	0.0
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	EUR 306	318,099	0.0
TEGNA, Inc.	4.63%	03/15/2028	USD 475	451,144	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	1,152	1,094,407	0.1
Univision Communications, Inc.	5.13%	05/15/2023	1,736	1,689,344	0.1
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025	28	26,747	0.0
UPC Holding BV	5.50%	01/15/2028	1,010	977,821	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	08/15/2026	975	1,010,836	0.1
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	206	212,338	0.0
Ziggo Bond Co. BV	6.00%	01/15/2027	470	493,549	0.1
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027	171	180,728	0.0
				16,096,573	1.3
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026	915	970,390	0.1
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	200	221,748	0.0
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	888	879,592	0.1
C&W Senior Financing DAC	7.50%	10/15/2026	440	449,703	0.0
CenturyLink, Inc.	5.13%	12/15/2026	290	292,925	0.0
CenturyLink, Inc., Series G	6.88%	01/15/2028	115	118,561	0.0
CenturyLink, Inc., Series S	6.45%	06/15/2021	230	237,506	0.0
CenturyLink, Inc., Series T	5.80%	03/15/2022	250	260,110	0.0
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	307	296,255	0.0
DKT Finance ApS	9.38%	06/17/2023	1,150	1,162,213	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	450	469,621	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Hughes Satellite Systems Corp.	7.63%	06/15/2021	USD 60	$ 62,761	0.0%
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	5.50%	08/01/2023	851	459,123	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA.	9.50%	09/30/2022	20	22,490	0.0
Level 3 Financing, Inc.	4.63%	09/15/2027	500	512,026	0.1
Level 3 Financing, Inc.	5.25%	03/15/2026	480	499,528	0.1
Nexstar Broadcasting, Inc.	5.63%	07/15/2027	66	67,640	0.0
Sprint Corp.	7.25%	09/15/2021	5	5,255	0.0
Sprint Corp.	7.88%	09/15/2023	183	207,413	0.0
T-Mobile USA, Inc.	5.38%	04/15/2027	500	532,919	0.1
T-Mobile USA, Inc.	6.50%	01/15/2026	210	221,824	0.0
Telecom Italia Capital SA	6.38%	11/15/2033	120	134,128	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	980	1,122,057	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	3	3,637	0.0
Zayo Group Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2027	263	258,804	0.0
Zayo Group Holdings, Inc.	6.13%	03/01/2028	1,125	1,114,609	0.1
				10,582,838	0.8
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025	505	541,681	0.1
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029	877	896,053	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	04/01/2025	1,248	1,187,890	0.1
Cooper-Standard Automotive, Inc.	5.63%	11/15/2026	835	534,805	0.1
Dana Financing Luxembourg SARL	5.75%	04/15/2025	5	4,956	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028	566	483,456	0.0
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023	1,208	1,253,668	0.1
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025	336	352,883	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.02%	03/06/2024	EUR 306	321,940	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.09%	01/09/2023	USD 200	188,589	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.10%	05/04/2023	317	295,907	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.22%	01/09/2022	317	304,648	0.0
Garrett LX I SARL/Garrett Borrowing LLC	5.13%	10/15/2026	EUR 629	461,683	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	9.50%	05/31/2025	USD 569	598,684	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.63%	05/15/2025	EUR 100	108,402	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.38%	05/15/2029	USD 534	504,511	0.0
Navistar International Corp.	6.63%	11/01/2025	1,178	1,107,013	0.1
Navistar International Corp.	9.50%	05/01/2025	116	125,596	0.0
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	6.25%	05/15/2026	1,157	1,185,542	0.1
Panther BF Aggregator 2 LP/Panther Finance Co., Inc.	8.50%	05/15/2027	814	797,720	0.1
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2026	1,026	521,894	0.0
Tesla, Inc.	5.30%	08/15/2025	915	915,180	0.1
Titan International, Inc.	6.50%	11/30/2023	101	55,357	0.0
Truck Hero, Inc.	8.50%	04/21/2024	463	416,700	0.0
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	751	732,347	0.1
				13,897,105	1.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
AMC Entertainment Holdings, Inc.	5.75%	06/15/2025	1,110	293,945	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op	5.38%	04/15/2027	760	724,216	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op	5.50%	05/01/2025	1,105	1,128,103	0.1
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	206	210,666	0.0
Mattel, Inc.	6.75%	12/31/2025	497	520,529	0.0
NCL Corp., Ltd.	3.63%	12/15/2024	1,200	721,589	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025	479	492,079	0.0
Six Flags Entertainment Corp.	4.88%	07/31/2024	760	715,776	0.1
Six Flags Entertainment Corp.	5.50%	04/15/2027	300	279,933	0.0
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	213	224,928	0.0
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	156	164,325	0.0
Viking Cruises Ltd.	5.88%	09/15/2027	1,240	745,371	0.1
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	950	778,410	0.1
				6,999,870	0.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	342	314,537	0.0
AZEK Co. LLC (The)	9.50%	05/15/2025	310	331,691	0.0
Beazer Homes USA, Inc.	5.88%	10/15/2027	28	26,344	0.0
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	17	17,117	0.0
Boyd Gaming Corp.	8.63%	06/01/2025	337	359,719	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US Corp.	4.88%	02/15/2030	499	421,676	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US Corp.	6.25%	09/15/2027	460	437,901	0.0
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025	432	423,526	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	4.88%	01/15/2030	3	2,982	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.13%	05/01/2026	1,435	1,446,313	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025	154	157,547	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.75%	05/01/2028	USD 166	$ 171,391	0.0%
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	33	33,397	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	02/15/2022	460	469,364	0.1
K. Hovnanian Enterprises, Inc.	10.00%	07/15/2022	13	6,382	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029	65	65,836	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	164	169,793	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC, Series WI	6.50%	09/15/2026	1,001	994,870	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	410	378,202	0.0
Mattamy Group Corp.	5.25%	12/15/2027	480	461,931	0.1
MGM Resorts International	5.50%	04/15/2027	123	119,661	0.0
Scientific Games International, Inc.	5.00%	10/15/2025	980	916,109	0.1
Scientific Games International, Inc.	7.00%	05/15/2028	25	22,027	0.0
Scientific Games International, Inc.	7.25%	11/15/2029	25	22,011	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	187	173,559	0.0
Stars Group Holdings BV/Stars Group US Co-Borrower LLC	7.00%	07/15/2026	758	804,469	0.1
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp.	5.88%	05/15/2025	24	21,856	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	129	126,988	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	193	192,392	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.88%	04/15/2023	50	49,875	0.0
Wyndham Destinations, Inc.	4.25%	03/01/2022	230	227,648	0.0
Wyndham Destinations, Inc.	5.75%	04/01/2027	651	591,060	0.1
Wyndham Hotels & Resorts, Inc.	5.38%	04/15/2026	480	458,027	0.1
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025	470	456,037	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	137	131,706	0.0
				11,003,944	0.9
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	4.38%	01/15/2028	130	127,808	0.0
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	5.75%	04/15/2025	297	315,602	0.0
Golden Nugget, Inc.	6.75%	10/15/2024	13	10,495	0.0
Golden Nugget, Inc.	8.75%	10/01/2025	670	441,978	0.1
IRB Holding Corp.	6.75%	02/15/2026	379	355,121	0.0
IRB Holding Corp.	7.00%	06/15/2025	300	310,945	0.0
Yum! Brands, Inc.	4.75%	01/15/2030	820	851,399	0.1
Yum! Brands, Inc.	7.75%	04/01/2025	244	270,036	0.0
				2,683,384	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Asbury Automotive Group, Inc.	4.50%	03/01/2028	74	70,577	0.0
Asbury Automotive Group, Inc.	4.75%	03/01/2030	45	43,199	0.0
Burlington Coat Factory Warehouse Corp.	6.25%	04/15/2025	71	73,685	0.0
L Brands, Inc.	5.25%	02/01/2028	364	307,554	0.0
L Brands, Inc.	5.63%	10/15/2023	379	365,526	0.0
L Brands, Inc.	6.75%	07/01/2036	347	288,570	0.0
L Brands, Inc.	6.88%	11/01/2035	627	518,711	0.1
L Brands, Inc.	7.50%	06/15/2029	117	103,345	0.0
Levi Strauss & Co.	5.00%	05/01/2025	23	23,552	0.0
Murphy Oil USA, Inc.	4.75%	09/15/2029	460	471,248	0.0
Murphy Oil USA, Inc.	5.63%	05/01/2027	4	4,165	0.0
Penske Automotive Group, Inc.	5.50%	05/15/2026	1,087	1,074,658	0.1
PetSmart, Inc.	5.88%	06/01/2025	260	261,777	0.0
PetSmart, Inc.	7.13%	03/15/2023	1,446	1,402,066	0.1
Rite Aid Corp.	7.50%	07/01/2025	1,786	1,778,708	0.2
Sonic Automotive, Inc.	6.13%	03/15/2027	26	25,734	0.0
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	1,555	1,360,952	0.1
Staples, Inc.	10.75%	04/15/2027	827	563,755	0.1
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024	70	66,527	0.0
William Carter Co. (The)	5.50%	05/15/2025	248	255,938	0.0
				9,060,247	0.7
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Air Medical Group Holdings, Inc.	6.38%	05/15/2023	230	219,677	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC	4.63%	01/15/2027	347	352,843	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC	4.88%	02/15/2030	240	248,718	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC	5.75%	03/15/2025	48	49,490	0.0
Avantor, Inc.	9.00%	10/01/2025	312	336,974	0.0
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	211	230,919	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	5.75%	08/15/2027	460	492,167	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.13%	04/15/2025	44	44,773	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	30	30,832	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	7.25%	05/30/2029	61	65,790	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	9.00%	12/15/2025	290	317,736	0.0

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
	Catalent Pharma Solutions, Inc.	4.88%	01/15/2026	USD	13	$ 13,336	0.0%
	Catalent Pharma Solutions, Inc.	5.00%	07/15/2027		450	463,462	0.0
	CHS/Community Health Systems, Inc.	6.25%	03/31/2023		221	214,318	0.0
	CHS/Community Health Systems, Inc.	6.63%	02/15/2025		530	510,220	0.1
	CHS/Community Health Systems, Inc.	8.13%	06/30/2024		33	23,624	0.0
	CHS/Community Health Systems, Inc.	8.63%	01/15/2024		940	947,445	0.1
	Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc.	6.00%	07/15/2023		675	519,750	0.1
	Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc.	6.00%	02/01/2025		484	353,320	0.0
	Envision Healthcare Corp.	8.75%	10/15/2026		1,006	442,642	0.0
	Hadrian Merger Sub, Inc.	8.50%	05/01/2026		22	18,451	0.0
	Hologic, Inc.	4.38%	10/15/2025		480	491,340	0.0
	Kronos Acquisition Holdings, Inc.	9.00%	08/15/2023		572	558,588	0.1
	Lamb Weston Holdings, Inc.	4.63%	11/01/2024		14	14,593	0.0
	Lamb Weston Holdings, Inc.	4.88%	11/01/2026		13	13,459	0.0
	LifePoint Health, Inc.	4.38%	02/15/2027		967	938,360	0.1
	Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC.	5.50%	04/15/2025		22	4,499	0.0
	MEDNAX, Inc.	5.25%	12/01/2023		6	5,887	0.0
	MEDNAX, Inc.	6.25%	01/15/2027		2,118	1,998,874	0.2
	MPH Acquisition Holdings LLC	7.13%	06/01/2024		756	715,963	0.1
	Post Holdings, Inc.	5.00%	08/15/2026		35	35,816	0.0
	Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029		64	67,233	0.0
	Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028		27	28,458	0.0
	Radiology Partners, Inc.	9.25%	02/01/2028		690	666,188	0.1
	RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc.	9.75%	12/01/2026		1,249	1,352,052	0.1
	Spectrum Brands, Inc.	6.13%	12/15/2024		70	71,775	0.0
	Tenet Healthcare Corp.	4.63%	07/15/2024		200	202,476	0.0
	Tenet Healthcare Corp.	4.88%	01/01/2026		577	592,617	0.1
	Tenet Healthcare Corp.	5.13%	05/01/2025		573	582,118	0.1
	Tenet Healthcare Corp.	6.25%	02/01/2027		425	439,927	0.0
	Tenet Healthcare Corp.	6.75%	06/15/2023		4	4,189	0.0
	Tenet Healthcare Corp.	8.13%	04/01/2022		272	285,689	0.0
	US Renal Care, Inc.	10.63%	07/15/2027		1,228	1,285,978	0.1
	Vizient, Inc.	6.25%	05/15/2027		21	22,147	0.0
	West Street Merger Sub, Inc.	6.38%	09/01/2025		1,732	1,712,882	0.1
						17,987,595	1.4
ENERGIE							
	Antero Resources Corp.	5.00%	03/01/2025		430	251,812	0.0
	Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026		101	76,373	0.0
	Callon Petroleum, Co.	6.25%	04/15/2023		15	4,918	0.0
	Callon Petroleum, Co.	8.25%	07/15/2025		10	2,996	0.0
	Cheniere Energy Partners LP	4.50%	10/01/2029		176	171,910	0.0
	CITGO Petroleum Corp.	6.25%	08/15/2022		497	489,545	0.1
	Denbury Resources, Inc.	7.75%	02/15/2024		76	31,346	0.0
	Denbury Resources, Inc.	9.25%	03/31/2022		108	45,667	0.0
	Diamond Offshore Drilling, Inc.(c)	4.88%	11/01/2043		85	9,535	0.0
	Diamond Offshore Drilling, Inc.(c)	7.88%	08/15/2025		280	30,792	0.0
	EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024		37	30,320	0.0
	EP Energy LLC/Everest Acquisition Finance, Inc.(c)	8.00%	02/15/2025		51	121	0.0
	EP Energy LLC/Everest Acquisition Finance, Inc.(c)	9.38%	05/01/2024		76	906	0.0
	EQT Corp.	3.90%	10/01/2027		395	346,519	0.0
	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024		18	16,475	0.0
	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026		75	67,016	0.0
	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025		493	449,320	0.1
	Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028		1,523	1,422,645	0.1
	Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	06/15/2023		112	105,985	0.0
	Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027		72	62,633	0.0
	Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027		245	60,253	0.0
	Gulfport Energy Corp.	6.00%	10/15/2024		19	11,092	0.0
	Gulfport Energy Corp.	6.38%	05/15/2025		26	13,181	0.0
	Gulfport Energy Corp.	6.38%	01/15/2026		571	283,244	0.0
	HighPoint Operating Corp.	7.00%	10/15/2022		21	5,920	0.0
	Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	10/01/2025		885	784,170	0.1
	Indigo Natural Resources LLC	6.88%	02/15/2026		422	408,296	0.1
	Ithaca Energy North Sea PLC	9.38%	07/15/2024		1,930	1,453,836	0.1
	Moss Creek Resources Holdings, Inc.	10.50%	05/15/2027		330	188,632	0.0
	Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026		152	86,614	0.0
	Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028		153	84,149	0.0
	Nabors Industries, Inc.	5.75%	02/01/2025		600	186,000	0.0
	Neptune Energy Bondco PLC	6.63%	05/15/2025		360	315,856	0.0
	NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023		658	511,860	0.1
	Noble Holding International Ltd.	5.25%	03/15/2042		3	91	0.0
	Noble Holding International Ltd.	6.20%	08/01/2040		7	148	0.0
	Noble Holding International Ltd.	7.75%	01/15/2024		10	239	0.0
	Noble Holding International Ltd.	7.95%	04/01/2025		12	302	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023	USD 408	$ 351,135	0.0%
Occidental Petroleum Corp.	2.90%	08/15/2024	145	114,753	0.0
Occidental Petroleum Corp.	3.40%	04/15/2026	37	27,361	0.0
Occidental Petroleum Corp.	3.50%	06/15/2025	188	146,669	0.0
Occidental Petroleum Corp.	6.95%	07/01/2024	70	63,337	0.0
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	22	20,320	0.0
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	51	48,518	0.0
QEP Resources, Inc.	5.25%	05/01/2023	778	414,935	0.1
QEP Resources, Inc.	5.38%	10/01/2022	35	19,920	0.0
Range Resources Corp.	5.00%	08/15/2022	23	21,529	0.0
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023	241	217,813	0.0
Range Resources Corp.	5.88%	07/01/2022	2	1,892	0.0
SM Energy Co.	5.00%	01/15/2024	824	435,367	0.1
SM Energy Co.	5.63%	06/01/2025	69	35,776	0.0
SM Energy Co.	6.75%	09/15/2026	15	7,660	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.50%	02/15/2026	644	653,660	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028	40	40,509	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	6.00%	04/15/2027	3	3,077	0.0
Transocean Phoenix 2 Ltd.	7.75%	10/15/2024	23	22,062	0.0
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	49	44,088	0.0
Transocean Sentry Ltd.	5.38%	05/15/2023	813	754,644	0.1
Transocean, Inc.	6.80%	03/15/2038	891	266,438	0.0
Transocean, Inc.	7.25%	11/01/2025	33	18,159	0.0
Transocean, Inc.	7.50%	01/15/2026	19	10,487	0.0
Transocean, Inc.	8.00%	02/01/2027	328	179,405	0.0
Vantage Drilling International(d)	7.50%	11/08/2020	40	0	0.0
Vine Oil & Gas LP/Vine Oil & Gas Finance Corp.	8.75%	04/15/2023	159	105,706	0.0
Western Midstream Operating LP	3.10%	02/01/2025	320	297,525	0.0
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	137	127,398	0.0
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022	156	153,207	0.0
Western Midstream Operating LP	4.05%	02/01/2030	278	249,438	0.0
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	383	348,450	0.0
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	167	152,356	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	104	84,908	0.0
Whiting Petroleum Corp.(c)	6.25%	04/01/2023	11	1,273	0.0
Whiting Petroleum Corp.(c)	6.63%	01/15/2026	70	7,986	0.0
				13,458,478	1.1
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	4.00%	01/15/2028	900	904,376	0.1
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	5.88%	05/15/2026	1,180	1,221,056	0.1
H&E Equipment Services, Inc.	5.63%	09/01/2025	905	885,893	0.1
IAA, Inc.	5.50%	06/15/2027	493	503,154	0.0
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025	637	603,754	0.0
Laureate Education, Inc.	8.25%	05/01/2025	42	44,370	0.0
				4,162,603	0.3
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.88%	07/15/2032	1,470	1,399,116	0.1
ADT Security Corp. (The)	6.25%	10/15/2021	70	72,501	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	1,166	1,231,771	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027	1,062	1,128,375	0.1
Aptim Corp.	7.75%	06/15/2025	30	10,500	0.0
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	79	74,409	0.0
APX Group, Inc.	7.63%	09/01/2023	85	76,945	0.0
APX Group, Inc.	7.88%	12/01/2022	373	389,785	0.0
Aramark Services, Inc.	5.00%	02/01/2028	786	774,610	0.1
Carriage Services, Inc.	6.63%	06/01/2026	35	36,442	0.0
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027	917	953,224	0.1
Gartner, Inc.	5.13%	04/01/2025	16	16,331	0.0
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027	163	149,145	0.0
Monitronics International, Inc.(d)	9.13%	04/01/2021	40	0	0.0
Nielsen Co. Luxembourg SARL (The)	5.00%	02/01/2025	1,276	1,285,731	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.00%	04/15/2022	20	19,970	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	651	678,472	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	705	733,175	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	1,002	951,981	0.1
Refinitiv US Holdings, Inc.	8.25%	11/15/2026	700	768,870	0.1
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025	12	12,359	0.0
Sabre GLBL, Inc.	5.38%	04/15/2023	986	931,634	0.1
Sabre GLBL, Inc.	9.25%	04/15/2025	364	390,550	0.0
Verscend Escrow Corp.	9.75%	08/15/2026	1,563	1,680,391	0.1
				13,766,287	1.1

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
TECHNOLOGIE						
	Banff Merger Sub, Inc.	9.75%	09/01/2026	USD 950	$ 953,018	0.1%
	Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	204	215,490	0.0
	CDK Global, Inc.	5.88%	06/15/2026	470	496,283	0.1
	CDW LLC/CDW Finance Corp.	4.13%	05/01/2025	382	392,044	0.0
	CommScope Technologies LLC	6.00%	06/15/2025	347	337,029	0.0
	CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024	506	519,690	0.1
	CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	31	32,649	0.0
	CommScope, Inc.	8.25%	03/01/2027	1,270	1,324,426	0.1
	EMC Corp.	3.38%	06/01/2023	490	491,288	0.0
	Microchip Technology, Inc.	4.25%	09/01/2025	341	343,020	0.0
	NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	54	53,915	0.0
	NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	908	904,657	0.1
	NCR Corp.	8.13%	04/15/2025	58	62,357	0.0
	Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	199	196,643	0.0
	Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028	403	398,591	0.0
	Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	64	65,432	0.0
	Solera LLC/Solera Finance, Inc.	10.50%	03/01/2024	435	442,316	0.0
	Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	02/01/2023	630	614,968	0.1
					7,843,816	0.6
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
	AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	860	644,396	0.1
	Algeco Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023	1,945	1,811,452	0.1
	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	29	22,225	0.0
	Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	10.50%	05/15/2025	495	550,781	0.0
	Herc Holdings, Inc.	5.50%	07/15/2027	782	761,732	0.1
	Hertz Corp. (The)(c)	5.50%	10/15/2024	181	30,468	0.0
	Hertz Corp. (The)(c)	6.00%	01/15/2028	1,530	259,758	0.0
	Hertz Corp. (The)(c)	6.25%	10/15/2022	120	20,279	0.0
	United Rentals North America, Inc.	5.50%	05/15/2027	18	19,123	0.0
	United Rentals North America, Inc.	5.88%	09/15/2026	729	766,824	0.1
	United Rentals North America, Inc.	6.50%	12/15/2026	3	3,208	0.0
	XPO Logistics, Inc.	6.13%	09/01/2023	28	28,435	0.0
	XPO Logistics, Inc.	6.75%	08/15/2024	359	376,624	0.0
					5,295,305	0.4
					169,564,229	13.5
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
	Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028	806	817,997	0.1
	Calpine Corp.	5.25%	06/01/2026	760	788,110	0.1
	Calpine Corp.	5.50%	02/01/2024	125	126,174	0.0
	NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027	3	3,203	0.0
	NRG Energy, Inc.	7.25%	05/15/2026	525	563,081	0.0
	Talen Energy Supply LLC	6.50%	06/01/2025	205	138,799	0.0
	Talen Energy Supply LLC	7.25%	05/15/2027	371	379,104	0.0
	Talen Energy Supply LLC	10.50%	01/15/2026	322	246,711	0.0
	Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	48	50,944	0.0
					3,114,123	0.2
					197,495,340	15.7
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
KOLUMBIEN						
	Colombian TES, Series B	10.00%	07/24/2024	COP 18,651,600	6,154,353	0.5
INDONESIEN						
	Indonesia Treasury Bond, Series FR44	10.00%	09/15/2024	IDR 85,501,000	6,488,654	0.5
	Indonesia Treasury Bond, Series FR56	8.38%	09/15/2026	1,376,000	100,298	0.0
	Indonesia Treasury Bond, Series FR70	8.38%	03/15/2024	2,113,000	151,931	0.0
	Indonesia Treasury Bond, Series FR71	9.00%	03/15/2029	31,042,000	2,321,245	0.2
	Indonesia Treasury Bond, Series FR78	8.25%	05/15/2029	22,719,000	1,639,585	0.2
	Indonesia Treasury Bond, Series FR81	6.50%	06/15/2025	21,208,000	1,427,657	0.1
					12,129,370	1.0
MEXIKO						
	Mexican Bonos, Series M	6.50%	06/10/2021	MXN 2,100	96,035	0.0
	Mexican Bonos, Series M	8.00%	09/05/2024	132,187	6,557,343	0.5
	Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047	9,444	471,812	0.0
	Mexican Bonos, Series M 20	7.50%	06/03/2027	31,868	1,568,735	0.1
	Mexican Bonos, Series M 20	10.00%	12/05/2024	37,077	1,978,251	0.2
					10,672,176	0.8

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
RUSSLAND							
	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6209	7.60%	07/20/2022	RUB	1,155	$ 17,369	0.0%
	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212	7.05%	01/19/2028		20,100	317,763	0.1
	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6215	7.00%	08/16/2023		103,605	1,569,868	0.1
	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6217	7.50%	08/18/2021		11,226	164,804	0.0
						2,069,804	0.2
VEREINIGTE STAATEN							
	U.S. Treasury Bonds	6.25%	05/15/2030	USD	250	386,172	0.0
	U.S. Treasury Notes	1.25%	05/15/2050		649	624,470	0.1
	U.S. Treasury Notes(e)	1.63%	08/15/2029		77,343	84,412,848	6.7
	U.S. Treasury Notes	2.13%	03/31/2024		3,000	3,215,156	0.3
	U.S. Treasury Notes	2.25%	02/15/2027		1,400	1,564,500	0.1
	U.S. Treasury Notes	2.38%	05/15/2029		10,951	12,647,943	1.0
	U.S. Treasury Notes(e)	2.50%	12/31/2020		2,689	2,724,627	0.2
	U.S. Treasury Notes(e)	2.50%	02/28/2021		6,574	6,686,482	0.5
	U.S. Treasury Notes(e)	2.63%	02/15/2029		7,402	8,684,628	0.7
	U.S. Treasury Notes	3.13%	11/15/2028		920	1,114,062	0.1
						122,060,888	9.7
						153,086,591	12.2
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE							
ANGOLA							
	Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029		1,936	1,196,690	0.1
	Angolan Government International Bond	8.25%	05/09/2028		1,215	749,124	0.1
	Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049		2,645	1,582,867	0.1
	Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048		202	120,379	0.0
	Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025		400	271,625	0.0
						3,920,685	0.3
ARGENTINIEN							
	Argentine Republic Government International Bond(c)	3.88%	01/15/2022	EUR	110	45,751	0.0
	Argentine Republic Government International Bond(c)	5.63%	01/26/2022	USD	146	57,670	0.0
	Argentine Republic Government International Bond(c)	5.88%	01/11/2028		679	246,137	0.0
	Argentine Republic Government International Bond(c)	6.63%	07/06/2028		733	264,110	0.0
	Argentine Republic Government International Bond(c)	6.88%	01/26/2027		2,664	965,700	0.1
	Argentine Republic Government International Bond(c)	6.88%	01/11/2048		1,402	496,834	0.1
	Argentine Republic Government International Bond(c)	7.50%	04/22/2026		6,802	2,572,006	0.2
	Argentine Republic Government International Bond(c)	7.82%	12/31/2033	EUR	22	10,432	0.0
	Argentine Republic Government International Bond, Series NY(c)	3.75%	12/31/2038	USD	195	73,877	0.0
						4,732,517	0.4
BAHRAIN							
	Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031		490	462,131	0.0
	Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029		400	409,000	0.0
	Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028		4,347	4,537,181	0.4
	CBB International Sukuk Programme Co. SPC	6.25%	11/14/2024		588	604,170	0.1
						6,012,482	0.5
BRASILIEN							
	Brazilian Government International Bond	4.63%	01/13/2028		2,305	2,409,445	0.2
COSTA RICA							
	Costa Rica Government International Bond	4.38%	04/30/2025		400	329,500	0.0
	Costa Rica Government International Bond	6.13%	02/19/2031		2,376	1,940,895	0.2
	Costa Rica Government International Bond	7.16%	03/12/2045		249	194,298	0.0
						2,464,693	0.2
DOMINIKANISCHE REPUBLIK							
	Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030		954	828,787	0.1
	Dominican Republic International Bond	5.50%	01/27/2025		100	99,625	0.0
	Dominican Republic International Bond	5.88%	04/18/2024		377	380,417	0.0
	Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060		275	232,805	0.0
	Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027		1,503	1,459,319	0.1
	Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028		150	144,469	0.0
	Dominican Republic International Bond	6.40%	06/05/2049		2,516	2,254,965	0.2
	Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026		1,794	1,845,017	0.2
	Dominican Republic International Bond	7.45%	04/30/2044		200	196,812	0.0
						7,442,216	0.6
ECUADOR							
	Ecuador Government International Bond(c)	7.88%	01/23/2028		3,724	1,314,572	0.2
	Ecuador Government International Bond(c)	7.95%	06/20/2024		500	211,500	0.0
	Ecuador Government International Bond(c)	8.88%	10/23/2027		280	101,360	0.0
	Ecuador Government International Bond(c)	9.50%	03/27/2030		221	80,333	0.0
	Ecuador Government International Bond(c)	9.65%	12/13/2026		580	215,760	0.0
	Ecuador Government International Bond(c)	10.75%	03/28/2022		200	88,200	0.0
						2,011,725	0.2

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÄGYPTEN							
	Egypt Government International Bond	6.13%	01/31/2022	USD	400	$ 405,750	0.0%
	Egypt Government International Bond	6.20%	03/01/2024		340	345,525	0.0
	Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027		2,745	2,851,369	0.2
	Egypt Government International Bond	7.60%	03/01/2029		1,100	1,113,062	0.1
	Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032		613	600,863	0.1
	Egypt Government International Bond	8.15%	11/20/2059		280	257,337	0.0
	Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047		1,056	1,025,970	0.1
	Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049		3,160	3,087,913	0.3
	Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050		1,210	1,194,875	0.1
						10,882,664	0.9
EL SALVADOR							
	El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027		4,066	3,323,955	0.3
	El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050		1,358	1,040,143	0.1
	El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035		28	22,348	0.0
	El Salvador Government International Bond	7.75%	01/24/2023		11	9,852	0.0
	El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029		190	162,153	0.0
						4,558,451	0.4
GABUN							
	Gabon Government International Bond	6.38%	12/12/2024		397	357,780	0.0
	Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031		1,649	1,374,339	0.1
	Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025		1,160	1,025,150	0.1
						2,757,269	0.2
GHANA							
	Ghana Government International Bond	6.38%	02/11/2027		2,809	2,504,399	0.2
	Ghana Government International Bond	8.13%	01/18/2026		466	451,583	0.0
	Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032		710	622,803	0.1
	Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030		370	413,128	0.0
						3,991,913	0.3
GUATEMALA							
	Guatemala Government Bond	4.50%	05/03/2026		218	223,586	0.0
	Guatemala Government Bond	4.88%	02/13/2028		1,021	1,068,860	0.1
	Guatemala Government Bond	4.90%	06/01/2030		1,198	1,255,280	0.1
	Guatemala Government Bond	5.38%	04/24/2032		246	266,141	0.0
	Guatemala Government Bond	6.13%	06/01/2050		238	268,419	0.0
						3,082,286	0.2
HONDURAS							
	Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027		2,936	3,062,615	0.3
	Honduras Government International Bond	7.50%	03/15/2024		400	423,125	0.0
						3,485,740	0.3
IRAK							
	Iraq International Bond	5.80%	01/15/2028		270	242,916	0.0
	Iraq International Bond	6.75%	03/09/2023		200	182,937	0.0
						425,853	0.0
ELFENBEINKÜSTE							
	Ivory Coast Government International Bond	5.38%	07/23/2024		2,567	2,449,079	0.2
	Ivory Coast Government International Bond	5.88%	10/17/2031	EUR	645	650,649	0.1
	Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	USD	2,315	2,178,270	0.1
	Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028		1,038	1,015,618	0.1
						6,293,616	0.5
JAMAIKA							
	Jamaica Government International Bond	6.75%	04/28/2028		1,253	1,316,825	0.1
	Jamaica Government International Bond	7.63%	07/09/2025		200	211,500	0.0
	Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045		749	827,177	0.1
						2,355,502	0.2
KENIA							
	Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024		640	614,200	0.1
	Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027		257	243,989	0.0
	Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028		1,783	1,684,378	0.1
						2,542,567	0.2
LIBANON							
	Lebanon Government International Bond(c)	6.65%	04/22/2024		25	4,305	0.0
	Lebanon Government International Bond(c)	6.85%	03/23/2027		69	11,903	0.0
	Lebanon Government International Bond, Series G(c)	1.00%	11/27/2026		817	142,464	0.0
						158,672	0.0
MONGOLEI							
	Mongolia Government International Bond	5.13%	12/05/2022		1,730	1,634,850	0.1
	Mongolia Government International Bond	10.88%	04/06/2021		200	203,750	0.0
						1,838,600	0.1

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
NAMIBIA						
	Namibia International Bonds	5.25%	10/29/2025	USD 200	$ 194,938	0.0%
NIGERIA						
	Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	763	676,924	0.1
	Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	500	437,188	0.0
	Nigeria Government International Bond	7.63%	11/21/2025	650	622,781	0.1
	Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	650	536,250	0.0
	Nigeria Government International Bond	8.75%	01/21/2031	1,940	1,820,569	0.1
					4,093,712	0.3
OMAN						
	Oman Government International Bond	4.13%	01/17/2023	335	308,305	0.0
	Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	535	470,967	0.1
	Oman Government International Bond	5.38%	03/08/2027	1,340	1,118,062	0.1
					1,897,334	0.2
PAKISTAN						
	Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	225	208,431	0.0
SENEGAL						
	Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 150	152,198	0.0
	Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	USD 1,417	1,324,010	0.1
	Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	1,712	1,541,870	0.1
					3,018,078	0.2
SÜDAFRIKA						
	Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029	2,392	2,182,700	0.2
	Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	1,621	1,321,115	0.1
	Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	09/16/2025	520	543,237	0.0
					4,047,052	0.3
SRI LANKA						
	Sri Lanka Government International Bond	6.85%	03/14/2024	780	440,944	0.0
	Sri Lanka Government International Bond	6.85%	11/03/2025	200	109,375	0.0
	Sri Lanka Government International Bond	7.55%	03/28/2030	1,499	808,991	0.1
					1,359,310	0.1
UKRAINE						
	Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	3,205	3,052,763	0.2
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2022	390	392,925	0.0
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2023	700	704,200	0.1
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2024	100	100,400	0.0
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	310	310,930	0.0
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	2,352	2,326,275	0.3
	Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2028	352	377,960	0.0
					7,265,453	0.6
					93,451,204	7.4
VORZUGSAKTIEN						
FINANZINSTITUTE						
REITS – DIVERSIFIZIERT						
	Armada Hoffler Properties, Inc., Series A	6.75%		44,789	911,008	0.1
	Colony Capital, Inc., Series H	7.13%		54,210	826,703	0.1
	Colony Capital, Inc., Series I	7.15%		61,400	922,842	0.1
	Colony Capital, Inc., Series J	7.13%		35,609	547,310	0.0
	Gladstone Commercial Corp., Series D	7.00%		29,823	709,787	0.1
	Gladstone Commercial Corp., Series E	6.63%		41,250	921,938	0.1
	Global Net Lease, Inc., Series A	7.25%		60,850	1,450,055	0.1
	Global Net Lease, Inc., Series B	6.88%		22,325	491,373	0.0
	PS Business Parks, Inc., Series X	5.25%		11,000	282,040	0.0
	PS Business Parks, Inc., Series Y	5.20%		18,450	473,612	0.0
	PS Business Parks, Inc., Series Z	4.88%		88,300	2,170,414	0.2
	VEREIT, Inc., Series F	6.70%		104,721	2,642,111	0.2
	Vornado Realty Trust, Series K	5.70%		33,315	817,883	0.1
	Vornado Realty Trust, Series L	5.40%		23,342	540,601	0.0
					13,707,677	1.1
REITS – GESUNDHEITSWESEN						
	Global Medical REIT, Inc., Series A	7.50%		18,099	452,475	0.0
REITS – HOTELS UND RESORTS						
	Ashford Hospitality Trust, Inc., Series D	8.45%		2,500	24,475	0.0
	Ashford Hospitality Trust, Inc., Series F	7.38%		14,775	114,654	0.0
	Ashford Hospitality Trust, Inc., Series G	7.38%		80,392	597,313	0.1
	Ashford Hospitality Trust, Inc., Series H	7.50%		14,584	110,109	0.0
	Ashford Hospitality Trust, Inc., Series I	7.50%		7,454	57,768	0.0
	Hersha Hospitality Trust, Series C	6.88%		36,948	437,834	0.0
	Hersha Hospitality Trust, Series D	6.50%		31,000	364,250	0.0
	Hersha Hospitality Trust, Series E	6.50%		13,700	162,208	0.0
	Pebblebrook Hotel Trust, Series C	6.50%		17,000	364,480	0.0

	Zinssatz	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
Pebblebrook Hotel Trust, Series D	6.38%	USD 36,100	$ 742,938	0.1%
Pebblebrook Hotel Trust, Series E	6.38%	4,200	89,670	0.0
Pebblebrook Hotel Trust, Series F	6.30%	4,053	87,302	0.0
Summit Hotel Properties, Inc., Series D	6.45%	9,025	164,706	0.0
Summit Hotel Properties, Inc., Series E	6.25%	61,647	1,091,152	0.1
Sunstone Hotel Investors, Inc., Series E	6.95%	42,050	1,026,861	0.1
Sunstone Hotel Investors, Inc., Series F	6.45%	47,398	1,144,662	0.1
			6,580,382	0.5
REITS – INDUSTRIE				
Monmouth Real Estate Investment Corp., Series C	6.13%	114,500	2,862,500	0.2
Rexford Industrial Realty, Inc., Series A	5.88%	7,372	187,249	0.0
Rexford Industrial Realty, Inc., Series B	5.88%	27,219	706,061	0.1
Rexford Industrial Realty, Inc., Series C	5.63%	33,975	865,231	0.1
STAG Industrial, Inc., Series C	6.88%	33,700	888,440	0.1
			5,509,481	0.5
REITS – BÜROS				
Boston Properties, Inc., Series B	5.25%	4,400	110,836	0.0
City Office REIT, Inc., Series A	6.63%	40,539	888,209	0.1
SL Green Realty Corp., Series I	6.50%	4,600	119,416	0.0
Vornado Realty Trust, Series M	5.25%	116,700	2,686,434	0.2
			3,804,895	0.3
IMMOBILIEN-BETRIEBSGESELLSCHAFTEN				
Brookfield Property Partners LP, Series A	5.75%	60,000	1,080,000	0.1
Brookfield Property Partners LP, Series A2	6.38%	105,525	2,110,500	0.2
			3,190,500	0.3
REITS – WOHNRAUM				
American Homes 4 Rent, Series D	6.50%	64,000	1,664,000	0.1
American Homes 4 Rent, Series E	6.35%	22,325	585,808	0.1
American Homes 4 Rent, Series F	5.88%	20,000	509,400	0.1
American Homes 4 Rent, Series G	5.88%	43,705	1,104,862	0.1
American Homes 4 Rent, Series H	6.25%	7,500	198,375	0.0
Investors Real Estate Trust, Series C	6.63%	2,750	70,675	0.0
UMH Properties, Inc., Series B	8.00%	16,500	414,150	0.0
UMH Properties, Inc., Series C	6.75%	18,675	444,652	0.0
UMH Properties, Inc., Series D	6.38%	121,520	2,830,201	0.2
			7,822,123	0.6
REITS – EINZELHANDEL				
Brookfield Property REIT, Inc., Series A	6.38%	48,175	775,136	0.1
Cedar Realty Trust, Inc., Series C	6.50%	47,325	648,352	0.1
Federal Realty Investment Trust, Series C	5.00%	19,700	500,183	0.0
National Retail Properties, Inc., Series F	5.20%	30,226	713,031	0.1
Saul Centers, Inc., Series D	6.13%	31,054	649,029	0.1
Saul Centers, Inc., Series E	6.00%	57,063	1,177,210	0.1
Seritage Growth Properties, Series A	7.00%	58,178	824,673	0.1
SITE Centers Corp., Series A	6.38%	98,794	1,987,735	0.1
SITE Centers Corp., Series K	6.25%	23,573	470,281	0.0
Spirit Realty Capital, Inc., Series A	6.00%	40,659	971,750	0.1
Taubman Centers, Inc., Series J	6.50%	7,775	176,493	0.0
Taubman Centers, Inc., Series K	6.25%	26,400	596,376	0.0
Urstadt Biddle Properties, Inc., Series H	6.25%	72,677	1,534,938	0.1
Urstadt Biddle Properties, Inc., Series K	5.88%	42,613	900,413	0.1
			11,925,600	1.0
REITS – SPEZIALISIERT				
Digital Realty Trust, Inc., Series C	6.63%	34,500	904,935	0.1
Digital Realty Trust, Inc., Series G	5.88%	11,700	302,211	0.0
Digital Realty Trust, Inc., Series I	6.35%	4,100	105,083	0.0
Digital Realty Trust, Inc., Series J	5.25%	26,103	675,024	0.1
Digital Realty Trust, Inc., Series K	5.85%	18,000	486,000	0.0
Digital Realty Trust, Inc., Series L	5.20%	138,916	3,547,915	0.3
EPR Properties, Series G	5.75%	64,562	1,122,733	0.1
National Storage Affiliates Trust, Series A	6.00%	94,600	2,536,226	0.2
Public Storage, Series C	5.13%	15,000	387,000	0.0
Public Storage, Series D	4.95%	5,000	127,700	0.0
Public Storage, Series E	4.90%	4,000	101,560	0.0
Public Storage, Series F	5.15%	13,275	347,805	0.0
Public Storage, Series G	5.05%	4,000	105,160	0.0
Public Storage, Series H	5.60%	25,000	689,500	0.1
Public Storage, Series K	4.75%	34,642	899,306	0.1
Public Storage, Series V	5.38%	5,000	127,750	0.0
Public Storage, Series W	5.20%	2,800	71,904	0.0
QTS Realty Trust, Inc., Series A	7.13%	63,942	1,755,847	0.1
			14,293,659	1.1
			67,286,792	5.4

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT							
FINANZINSTITUTE							
BANKWESEN							
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	USD	649	$	810,725	0.1%
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025		511		546,642	0.1
Banco Santander SA	2.75%	05/28/2025		400		407,981	0.0
Banco Santander SA	3.49%	05/28/2030		200		204,413	0.0
Bank of America Corp., Series DD(a)	6.30%	03/10/2026		144		158,431	0.0
Bank of America Corp., Series JJ(a)	5.13%	06/20/2024		1,274		1,240,690	0.1
Bank of America Corp., Series X(a)	6.25%	09/05/2024		140		146,270	0.0
Bank of America Corp., Series Z(a)	6.50%	10/23/2024		445		475,668	0.1
Barclays PLC(a)	7.88%	03/15/2022		207		210,285	0.0
BNP Paribas SA(a)	6.75%	03/14/2022		200		205,664	0.0
BNP Paribas SA(a)	7.63%	03/30/2021		1,043		1,072,110	0.1
CIT Group, Inc.	5.00%	08/15/2022		460		461,673	0.0
CIT Group, Inc.	5.00%	08/01/2023		70		70,428	0.0
Citigroup, Inc.(a)	5.95%	01/30/2023		67		67,256	0.0
Citigroup, Inc., Series T(a)	6.25%	08/15/2026		99		104,546	0.0
Citigroup, Inc., Series U(a)	5.00%	09/12/2024		945		884,857	0.1
Citigroup, Inc., Series V(a)	4.70%	01/30/2025		285		248,789	0.0
Credit Agricole SA(a)	8.13%	12/23/2025		1,045		1,198,107	0.1
DNB Bank ASA(a)	6.50%	03/26/2022		1,085		1,118,665	0.1
Erste Group Bank AG(a)	6.50%	04/15/2024	EUR	400		460,926	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(a)	5.30%	11/10/2026	USD	9		9,165	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(a)	5.00%	11/10/2022		792		729,506	0.1
HSBC Holdings PLC(a)	6.00%	05/22/2027		1,078		1,052,061	0.1
ING Groep NV(a)	5.75%	11/16/2026		420		408,975	0.0
ING Groep NV(a)	6.75%	04/16/2024		200		202,105	0.0
ING Groep NV(a)	6.88%	04/16/2022		303		311,433	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series FF(a)	5.00%	08/01/2024		235		220,872	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series HH(a)	4.60%	02/01/2025		327		288,538	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series V(a) (f)	4.75%	07/01/2020		17		14,464	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series X(a)	6.10%	10/01/2024		750		765,093	0.1
KBC Group NV(a)	4.25%	10/24/2025	EUR	1,000		1,062,602	0.1
Lloyds Banking Group PLC	3.00%	01/11/2022	USD	209		214,772	0.0
Lloyds Banking Group PLC(a)	6.66%	05/21/2037		76		84,048	0.0
Lloyds Banking Group PLC(a)	7.50%	06/27/2024		434		444,442	0.0
Morgan Stanley	4.10%	05/22/2023		50		53,614	0.0
Royal Bank of Scotland Group PLC	2.00%	03/04/2025	EUR	115		129,592	0.0
Royal Bank of Scotland Group PLC(a)	8.63%	08/15/2021	USD	1,908		1,986,747	0.2
Standard Chartered PLC(a)	7.50%	04/02/2022		1,215		1,253,173	0.1
Standard Chartered PLC(a)	7.75%	04/02/2023		730		753,834	0.1
State Street Corp.	2.90%	03/30/2026		68		72,915	0.0
State Street Corp.	3.15%	03/30/2031		94		103,920	0.0
Swedbank AB(a)	6.00%	03/17/2022		400		400,382	0.0
Swedbank AB, Series NC5(a)	5.63%	09/17/2024		200		198,582	0.0
UBS Group AG(a)	6.88%	03/22/2021		617		625,312	0.1
UBS Group AG(a)	7.00%	02/19/2025		1,862		2,030,003	0.2
						23,510,276	1.9
MAKLER							
Charles Schwab Corp. (The), Series G(a)	5.38%	06/01/2025		673		706,400	0.1
FINANZEN							
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023		238		210,876	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.65%	07/21/2027		207		171,086	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028		207		172,593	0.0
Synchrony Financial	2.85%	07/25/2022		341		336,591	0.1
Synchrony Financial	4.25%	08/15/2024		90		89,975	0.0
Synchrony Financial	4.38%	03/19/2024		212		213,648	0.0
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025		247		248,891	0.0
						1,443,660	0.1
VERSICHERUNGEN							
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057		80		93,375	0.0
Centene Corp.	5.38%	08/15/2026		37		39,267	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR	290		305,083	0.1
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	USD	100		126,316	0.0
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039		60		91,201	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.	9.38%	08/15/2039		30		46,721	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044		28		28,251	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043		81		83,997	0.0
Transatlantic Holdings, Inc.	8.00%	11/30/2039		20		29,600	0.0
						843,811	0.1

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
REITS								
	GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	4.00%	01/15/2030	USD	64	$	56,038	0.0%
	GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025		46		46,229	0.0
	GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026		35		35,185	0.0
	GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.75%	06/01/2028		57		57,282	0.0
	Healthpeak Properties, Inc.	3.40%	02/01/2025		90		93,672	0.0
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029		376		374,756	0.0
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027		471		486,624	0.1
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.50%	05/01/2024		8		8,101	0.0
	Sabra Health Care LP	4.80%	06/01/2024		74		72,639	0.0
	Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030		311		268,918	0.0
	Welltower, Inc.	4.50%	01/15/2024		80		83,711	0.0
	Weyerhaeuser Co.	7.38%	03/15/2032		20		26,457	0.0
							1,609,612	0.1
							28,113,759	2.3
INDUSTRIE								
GRUNDSTOFFE								
	Anglo American Capital PLC	5.38%	04/01/2025		518		568,048	0.1
	ArcelorMittal	6.13%	06/01/2025		73		79,286	0.0
	ArcelorMittal SA	7.25%	10/15/2039		36		42,878	0.0
	Braskem America Finance Co.	7.13%	07/22/2041		316		312,020	0.0
	Braskem Finance Ltd.	6.45%	02/03/2024		602		631,528	0.1
	Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030		1,000		866,250	0.1
	Fresnillo PLC	5.50%	11/13/2023		200		215,367	0.0
	Glencore Funding LLC	4.63%	04/29/2024		11		11,793	0.0
	Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024		250		269,531	0.0
	GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030		200		186,905	0.0
	Huntsman International LLC	5.13%	11/15/2022		26		26,842	0.0
	Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049		282		293,368	0.0
	International Paper Co.	3.80%	01/15/2026		90		99,606	0.0
	MEGlobal Canada ULC	5.00%	05/18/2025		238		244,858	0.0
	Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027		1,106		1,064,685	0.1
	Nutrien Ltd.	3.38%	03/15/2025		65		69,223	0.0
	Suzano Austria GmbH	7.00%	03/16/2047		761		826,655	0.1
	WestRock MWV LLC	8.20%	01/15/2030		10		13,540	0.0
							5,822,383	0.5
INVESTITIONSGÜTER								
	Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027		119		108,392	0.0
	General Electric Co., Series D(a)	5.00%	01/21/2021		266		204,155	0.0
							312,547	0.0
KOMMUNIKATIONSMEDIEN								
	Fox Corp.	3.05%	04/07/2025		106		113,039	0.0
	Prosus NV	3.68%	01/21/2030		509		526,895	0.1
	ViacomCBS, Inc.	4.75%	05/15/2025		1,380		1,511,517	0.1
							2,151,451	0.2
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION								
	Crown Castle International Corp.	4.88%	04/15/2022		40		42,746	0.0
	Hughes Satellite Systems Corp.	5.25%	08/01/2026		460		476,211	0.0
	Qwest Corp.	6.75%	12/01/2021		460		483,826	0.1
							1,002,783	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ								
	General Motors Co.	4.88%	10/02/2023		255		263,624	0.0
	General Motors Co.	6.13%	10/01/2025		23		25,070	0.0
	General Motors Co.	6.80%	10/01/2027		181		206,613	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	3.25%	01/05/2023		105		104,409	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	3.50%	11/07/2024		57		56,134	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	3.70%	05/09/2023		168		167,639	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	3.95%	04/13/2024		105		105,147	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	4.15%	06/19/2023		65		65,943	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	4.25%	05/15/2023		14		14,186	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	4.30%	07/13/2025		119		120,524	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	5.10%	01/17/2024		182		189,153	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	5.20%	03/20/2023		110		114,676	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	5.25%	03/01/2026		69		72,304	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029		423		458,600	0.1
	Lear Corp.	3.50%	05/30/2030		316		281,094	0.1
	Lear Corp.	3.80%	09/15/2027		213		203,229	0.0
							2,448,345	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG								
	Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023		1,911		2,031,552	0.2
	Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023		738		769,365	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	USD 1,471	$ 1,551,905	0.1%
Silversea Cruise Finance Ltd.	7.25%	02/01/2025	44	41,716	0.0
				4,394,538	0.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Lennar Corp.	4.75%	11/29/2027	3	3,270	0.0
Marriott International, Inc./MD	5.75%	05/01/2025	176	190,624	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	2,054	2,156,672	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	12	15,069	0.0
PulteGroup, Inc.	5.50%	03/01/2026	1,120	1,237,368	0.1
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	16	18,065	0.0
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	30	36,517	0.0
Standard Industries, Inc./NJ	5.38%	11/15/2024	30	30,607	0.0
Standard Industries, Inc./NJ	6.00%	10/15/2025	477	495,442	0.0
				4,183,634	0.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
TJX Cos., Inc. (The)	3.50%	04/15/2025	344	383,669	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Sysco Corp.	5.65%	04/01/2025	100	114,184	0.0
Sysco Corp.	5.95%	04/01/2030	61	73,248	0.0
Universal Health Services, Inc.	4.75%	08/01/2022	31	31,069	0.0
				218,501	0.0
ENERGIE					
Apache Corp.	5.35%	07/01/2049	888	682,674	0.1
Apache Corp.	7.75%	12/15/2029	17	16,396	0.0
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	3	2,689	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045	198	205,759	0.0
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	429	433,798	0.0
Energy Transfer Operating LP	4.75%	01/15/2026	650	694,247	0.1
Energy Transfer Partners LP/Regency Energy Finance Corp.	4.50%	11/01/2023	94	98,520	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.80%	08/01/2031	80	103,534	0.0
Marathon Petroleum Corp.	4.50%	05/01/2023	451	480,897	0.0
Marathon Petroleum Corp.	4.70%	05/01/2025	391	432,294	0.0
Marathon Petroleum Corp.	4.75%	12/15/2023	62	67,197	0.0
ONEOK, Inc.	2.20%	09/15/2025	213	202,743	0.0
ONEOK, Inc.	2.75%	09/01/2024	753	743,556	0.1
ONEOK, Inc.	5.85%	01/15/2026	427	471,168	0.0
Parsley Energy LLC/Parsley Finance Corp.	5.63%	10/15/2027	242	237,160	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	9.25%	05/15/2025	563	609,543	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.60%	11/01/2024	165	165,142	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	206	209,390	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.65%	10/15/2025	537	548,696	0.1
Sunoco Logistics Partners Operations LP	3.90%	07/15/2026	60	60,042	0.0
Williams Cos., Inc. (The)	3.35%	08/15/2022	48	49,468	0.0
WPX Energy, Inc.	8.25%	08/01/2023	5	5,425	0.0
				6,520,338	0.5
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Alfa SAB de CV	6.88%	03/25/2044	231	251,862	0.0
DIENSTLEISTUNGEN					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	400	427,303	0.0
Expedia Group, Inc.	7.00%	05/01/2025	735	785,994	0.1
Verisk Analytics, Inc.	5.50%	06/15/2045	19	24,342	0.0
				1,237,639	0.1
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.08%	04/07/2025	237	246,641	0.0
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	201	214,568	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	224	250,481	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	6.02%	06/15/2026	89	100,696	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	8.35%	07/15/2046	9	11,403	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	3.50%	04/15/2023	48	51,117	0.0
KLA Corp.	4.65%	11/01/2024	95	107,270	0.0
Lam Research Corp.	3.80%	03/15/2025	55	61,433	0.0
Nokia Oyj	6.63%	05/15/2039	40	44,026	0.0
Seagate HDD Cayman	4.75%	01/01/2025	19	20,182	0.0
Seagate HDD Cayman	4.88%	06/01/2027	184	195,624	0.0
Western Digital Corp.	4.75%	02/15/2026	1,260	1,327,575	0.1
				2,631,016	0.2
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	1,306	1,351,671	0.1
Southwest Airlines Co.	4.75%	05/04/2023	491	498,190	0.0
Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025	510	518,199	0.1
				2,368,060	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	USD 200	$ 208,300	0.0%
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022	513	430,725	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	63	43,488	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023	219	174,475	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	217	161,312	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	79	57,015	0.0
DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029	209	200,904	0.0
DP World PLC	5.63%	09/25/2048	249	252,151	0.0
				1,320,070	0.1
				35,455,136	2.8
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Colbun SA	3.15%	03/06/2030	404	394,011	0.1
Consorcio Transmantaro SA	4.38%	05/07/2023	200	206,460	0.0
Enel Generacion Chile SA	4.25%	04/15/2024	70	73,390	0.0
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	2.75%	05/01/2025	330	353,361	0.0
				1,027,222	0.1
				64,596,117	5.2
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-1A, Class M2(f)	3.07%	04/25/2028	250	212,695	0.0
Series 2019-1A, Class M2(f)	2.87%	03/25/2029	235	180,505	0.0
Series 2019-2A, Class M1C(f)	2.17%	04/25/2029	205	190,784	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1B1(f)	4.52%	04/25/2031	24	19,795	0.0
Series 2018-R07, Class 1M2(f)	2.57%	04/25/2031	544	534,081	0.1
Series 2019-R01, Class 2M2(f)	2.62%	07/25/2031	241	237,315	0.0
Series 2019-R02, Class 1M2(f)	2.47%	08/25/2031	153	149,073	0.0
Series 2019-R03, Class 1M2(f)	2.32%	09/25/2031	407	397,401	0.1
Series 2019-R07, Class 1M2(f)	2.27%	10/25/2039	1,195	1,126,346	0.1
Series 2020-SBT1, Class 1M2(f)	3.82%	02/25/2040	598	457,159	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(f)	3.82%	02/25/2040	237	162,734	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Series 2013-DN1, Class M2(f)	7.32%	07/25/2023	324	281,617	0.0
Series 2018-DNA1, Class B1(f)	3.32%	07/25/2030	110	89,394	0.0
Series 2018-HQA2, Class B1(f)	4.42%	10/25/2048	2,000	1,521,517	0.1
Series 2019-DNA1, Class M2(f)	2.82%	01/25/2049	200	190,395	0.0
Series 2019-DNA3, Class B1(f)	3.42%	07/25/2049	3,000	2,430,357	0.2
Series 2019-DNA4, Class M2(f)	2.12%	10/25/2049	777	734,512	0.1
Series 2019-HQA3, Class M2(f)	2.02%	09/25/2049	666	637,354	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2015-DNA3, Class B(f)	9.52%	04/25/2028	247	199,614	0.0
Series 2016-DNA3, Class B(f)	11.42%	12/25/2028	248	229,731	0.0
Series 2017-DNA1, Class B1(f)	5.12%	07/25/2029	250	214,956	0.0
Series 2017-DNA3, Class M2(f)	2.67%	03/25/2030	250	250,000	0.0
Series 2017-HQA1, Class M2(f)	3.72%	08/25/2029	229	229,407	0.0
Series 2017-HQA3, Class M2(f)	2.52%	04/25/2030	210	208,671	0.0
Series 2018-DNA1, Class M2(f)	1.97%	07/25/2030	236	224,294	0.0
Series 2019-DNA3, Class M2(f)	2.22%	07/25/2049	24	23,170	0.0
Series 2020-DNA1, Class M2(f)	1.87%	01/25/2050	1,233	1,115,740	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C02, Class 1M2(f)	2.77%	05/25/2024	48	37,514	0.0
Series 2014-C03, Class 1M2(f)	3.17%	07/25/2024	38	29,607	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(f)	5.07%	11/25/2024	20	20,594	0.0
Series 2015-C01, Class 1M2(f)	4.47%	02/25/2025	41	38,701	0.0
Series 2015-C02, Class 1M2(f)	4.17%	05/25/2025	29	27,138	0.0
Series 2015-C02, Class 2M2(f)	4.17%	05/25/2025	20	19,507	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(f)	5.72%	04/25/2028	108	113,590	0.0
Series 2016-C02, Class 1B(f)	12.42%	09/25/2028	20	19,870	0.0
Series 2016-C03, Class 2M2(f)	6.07%	10/25/2028	66	70,118	0.0
Series 2016-C05, Class 2B(f)		01/25/2029	81	74,452	0.0
Series 2016-C05, Class 2M2(f)	4.62%	01/25/2029	36	36,596	0.0
Series 2016-C06, Class 1B(f)	9.42%	04/25/2029	38	34,985	0.0
Series 2016-C06, Class 1M2(f)	4.42%	04/25/2029	196	202,242	0.0
Series 2016-C07, Class 2B(f)	9.67%	05/25/2029	41	34,890	0.0
Series 2016-C07, Class 2M2(f)	4.52%	05/25/2029	89	91,370	0.0
Series 2017-C01, Class 1B1(f)	5.92%	07/25/2029	3,173	2,886,808	0.3
Series 2017-C02, Class 2M2(f)	3.82%	09/25/2029	477	476,684	0.1
Series 2017-C03, Class 1B1(f)	5.02%	10/25/2029	423	368,838	0.0
Series 2017-C05, Class 1B1(f)	3.77%	01/25/2030	229	182,353	0.0

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
Series 2017-C06, Class 1B1(f)	4.32%	02/25/2030	USD	921	$ 725,830	0.1%
Series 2017-C06, Class 2M2(f)	2.97%	02/25/2030		197	191,575	0.0
Series 2017-C07, Class 1M2(f)	2.57%	05/25/2030		239	234,278	0.0
Series 2017-C07, Class 2M2(f)	2.67%	05/25/2030		366	351,203	0.0
Series 2018-C01, Class 1B1(f)	3.72%	07/25/2030		248	208,130	0.0
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M2(f)	3.17%	10/25/2028		150	124,812	0.0
Mortgage Insurance-Linked Notes						
Series 2019-1, Class M2(f)	3.07%	11/26/2029		850	744,175	0.1
Series 2020-1, Class M1B(f)	1.62%	02/25/2030		397	361,721	0.0
					19,956,198	1.6
VARIABEL VERZINSLICHE STAATSPAPIERE						
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs						
Series 3346, Class SC(f) (g)	6.37%	10/15/2033		11,636	2,563,353	0.2
Series 4954, Class SL(f) (g)	5.87%	02/25/2050		15,965	3,091,456	0.2
					5,654,809	0.4
					25,611,007	2.0
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
BRASILIEN						
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2021	BRL	93,815	18,334,727	1.5
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2023		4,364	927,859	0.1
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2025		1,104	240,425	0.0
					19,503,011	1.6
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
Dominican Republic International Bond	15.95%	06/04/2021	DOP	6,500	115,370	0.0
SÜDAFRIKA						
Republic of South Africa Government Bond, Series 2023	7.75%	02/28/2023	ZAR	18,000	1,089,662	0.1
Republic of South Africa Government Bond, Series 2030	8.00%	01/31/2030		51,934	2,786,722	0.2
					3,876,384	0.3
TÜRKEI						
Turkey Government Bond	23.00%	08/12/2020	TRY	3,300	495,459	0.0
					23,990,224	1.9
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
FINANZINSTITUTE						
SONSTIGE FINANZWERTE						
CSN Islands XI Corp.	6.75%	01/28/2028	USD	452	349,237	0.0
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Consolidated Energy Finance SA	6.50%	05/15/2026		205	159,900	0.0
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025		2,265	1,913,572	0.1
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023		469	399,823	0.0
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026		1,220	994,109	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	04/01/2023		889	818,991	0.1
					4,286,395	0.3
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
MTN Mauritius Investments Ltd.	5.37%	02/13/2022		200	202,812	0.0
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027		1,106	1,117,330	0.1
VF Ukraine PAT via VFU Funding PLC	6.20%	02/11/2025		230	223,747	0.0
					1,543,889	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029		766	747,329	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027		460	459,783	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024		250	249,299	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.13%	12/15/2029		1,055	1,023,350	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027		470	468,678	0.0
					2,948,439	0.2
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026		414	392,913	0.0
BRF SA	4.88%	01/24/2030		1,148	1,059,030	0.1
MARB BondCo PLC	6.88%	01/19/2025		400	401,889	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.13%	01/31/2025		260	279,775	0.0
					2,133,607	0.2
ENERGIE						
Geopark Ltd.	5.50%	01/17/2027		284	235,631	0.1
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026		200	168,063	0.0
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034		197	181,928	0.0
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030		300	211,312	0.0
Petrobras Global Finance BV	5.09%	01/15/2030		155	148,268	0.0
Petrobras Global Finance BV	5.60%	01/03/2031		310	304,134	0.1
Petrobras Global Finance BV	6.90%	03/19/2049		220	218,051	0.0

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
	Petrobras Global Finance BV	7.38%	01/17/2027	USD	1,345	$ 1,466,613	0.1%
	Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026		125	146,389	0.0
						3,080,389	0.3
						13,992,719	1.1
VERSORGUNGSBETRIEBE							
ELEKTRIZITÄT							
	Cemig Geracao e Transmissao SA	9.25%	12/05/2024		917	985,058	0.1
	Centrais Eletricas Brasileiras SA	3.63%	02/04/2025		323	300,713	0.0
	Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	7.25%	05/03/2023		429	424,710	0.1
	Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033		181	174,371	0.0
						1,884,852	0.2
						16,226,808	1.3
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE							
QUASI-STAATSANLEIHEN							
BAHRAIN							
	Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).	7.50%	10/25/2027		200	203,125	0.0
	Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).	8.38%	11/07/2028		200	208,000	0.0
						411,125	0.0
INDONESIEN							
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030		269	288,086	0.0
MEXIKO							
	Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031		2,580	2,086,574	0.2
	Petroleos Mexicanos	6.50%	01/23/2029		346	295,103	0.0
	Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047		407	315,934	0.0
	Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030		338	288,988	0.0
	Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050		1,862	1,550,116	0.2
						4,536,715	0.4
TRINIDAD & TOBAGO							
	Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027		260	223,925	0.0
UKRAINE							
	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2026		520	476,775	0.1
	State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025		229	230,145	0.0
						706,920	0.1
VEREINIGTE STAATEN							
	Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024		69	66,975	0.0
						6,233,746	0.5
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN							
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS							
	iShares JP Morgan USD Emerging Markets Bond ETF				41,641	4,377,718	0.4
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS							
CLO – VARIABEL VERZINSLICH							
	Bardot CLO Ltd., Series 2019-2A, Class C(f).	3.85%	10/22/2032	USD	250	245,255	0.0
	CIFC Funding Ltd., Series 2017-3A, Class A1(f)	2.36%	07/20/2030		250	245,782	0.0
	CIFC Funding Ltd., Series 2019-3A, Class B(f)	3.83%	07/16/2032		250	248,355	0.1
	THL Credit Wind River CLO Ltd., Series 2017-4A, Class A(f)	1.53%	11/20/2030		250	243,950	0.0
	TICP CLO XII Ltd., Series 2018-12A, Class A(f).	2.33%	01/15/2031		250	246,666	0.0
						1,230,008	0.1
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN							
KOLUMBIEN							
	Colombia Government International Bond	8.13%	05/21/2024		20	23,988	0.0
ISRAEL							
	Israel Government International Bond.	2.75%	07/03/2030		494	536,499	0.0
MEXIKO							
	Mexico Government International Bond	4.75%	04/27/2032		297	321,502	0.1
	Mexico Government International Bond	5.00%	04/27/2051		276	296,700	0.0
						618,202	0.1
PHILIPPINEN							
	Philippine Government International Bond	9.50%	02/02/2030		20	32,500	0.0
						1,211,189	0.1
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN							
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS							
	GS Mortgage Securities Trust, Series 2011-GC5, Class D	5.39%	08/10/2044		493	357,058	0.1
	UBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(h)	1.56%	06/15/2050		2,181	167,313	0.0
						524,371	0.1
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS							
	DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(f)	3.19%	12/19/2030		100	82,348	0.0
						606,719	0.1

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
BANKDARLEHEN							
FINANZINSTITUTE							
FINANZEN							
	Jefferies Finance LLC(f)	3.19%	06/03/2026	USD	48	$ 44,432	0.0%
INDUSTRIE							
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER							
	U.S. Renal Care, Inc.(f)	5.19%	06/26/2026		86	81,807	0.0
ENERGIE							
	Triton Solar US Acquisition Co.(f)	7.07%	10/29/2024		124	104,029	0.0
TECHNOLOGIE							
	Pitney Bowes Inc.(f)	5.68%	01/07/2025		246	194,832	0.0
						380,668	0.0
						425,100	0.0
SCHWELLENMÄRKTE – HARTWÄHRUNG							
INDUSTRIE							
	Digicel International Finance Ltd./Digicel Holdings Bermuda Ltd.	8.00%	12/31/2026		39	22,428	0.0
	Digicel International Finance Ltd./Digicel Holdings Bermuda Ltd.	8.75%	05/25/2024		97	92,991	0.0
	Digicel International Finance Ltd./Digicel Holdings Bermuda Ltd.	13.00%	12/31/2025		49	42,685	0.0
						158,104	0.0
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN							
	Tobacco Settlement Finance Authority, Series 2007A	7.47%	06/01/2047		150	150,147	0.0
ABS-ANLEIHEN							
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS							
	Taco Bell Funding LLC, Series 2016-1A, Class A23	4.97%	05/25/2046		39	40,434	0.0
OPTIONSSCHEINE							
	Avaya Holdings Corp., expiring 12/15/22				1,190	1,785	0.0
						1,020,405,268	81.3
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE							
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT							
FINANZINSTITUTE							
MAKLER							
	NFP Corp.	8.00%	07/15/2025	USD	204	195,315	0.0
FINANZEN							
	Enova International, Inc.	8.50%	09/01/2024		11	9,346	0.0
	Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025		85	72,887	0.0
	Navient Corp.	5.88%	03/25/2021		79	77,403	0.0
						159,636	0.0
						354,951	0.0
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
	Axalta Coating Systems LLC	4.88%	08/15/2024		300	304,726	0.0
	Berry Global, Inc.	4.50%	02/15/2026		480	483,825	0.1
						788,551	0.1
KOMMUNIKATIONSMEDIEN							
	National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028		128	102,249	0.0
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION							
	Sprint Corp.	7.63%	03/01/2026		33	39,432	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE							
	Boyd Gaming Corp.	4.75%	12/01/2027		97	89,291	0.0
	Forestar Group, Inc	5.00%	03/01/2028		201	189,223	0.0
	Forestar Group, Inc.	8.00%	04/15/2024		49	49,438	0.0
	Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	6.13%	04/01/2025		546	546,628	0.1
	Twin River Worldwide Holdings, Inc.	6.75%	06/01/2027		66	60,776	0.0
	Wyndham Destinations, Inc.	4.63%	03/01/2030		237	204,813	0.0
						1,140,169	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER							
	Newell Brands, Inc.	6.00%	04/01/2046		480	497,582	0.0
ENERGIE							
	Comstock Resources Inc.	7.50%	05/15/2025		55	48,526	0.0
	EP Energy LLC/Everest Acquisition Finance, Inc.(c)	7.75%	09/01/2022		112	60	0.0
	Parkland Corp./Canada	6.00%	04/01/2026		55	55,554	0.0
						104,140	0.0
						2,672,123	0.2
						3,027,074	0.2

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettover-mögen %
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN						
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH						
Bellemeade Re Ltd., Series 2019-3A, Class M1C(f)	2.12%	07/25/2029	USD	208	$ 161,374	0.0%
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2020-DNA2, Class B2(f)	4.97%	02/25/2050		4,000	1,999,495	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(f)	2.52%	02/27/2023		1,050	829,210	0.1
					2,990,079	0.2
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	05/15/2022		220	208,587	0.0
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030		695	598,395	0.1
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Kenbourne Invest SA	6.88%	11/26/2024		414	412,965	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Cosan Ltd.	5.50%	09/20/2029		225	201,935	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
Rumo Luxembourg SARL	5.88%	01/18/2025		200	205,070	0.0
					1,626,952	0.1
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
AES Gener SA	6.35%	10/07/2079		210	200,897	0.0
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026		263	258,632	0.1
					459,529	0.1
					2,086,481	0.2
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
ÄGYPTEN						
Egypt Treasury Bills, Series 273D	0.00%	07/28/2020	EGP	32,275	1,990,478	0.2
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
ARGENTINIEN						
Argentine Bonos del Tesoro(c)	15.50%	10/17/2026	ARS	145	512	0.0
Argentine Bonos del Tesoro(c)	18.20%	10/03/2021		1,505	9,439	0.0
					9,951	0.0
UKRAINE						
Ukraine Government Bond	16.00%	08/11/2021	UAH	45,000	1,738,773	0.1
					1,748,724	0.1
VORZUGSAKTIEN						
IMMOBILIEN						
REITS – WOHNRAUM						
Bluerock Residential Growth REIT, Inc., Series C	7.63%			21	478,009	0.0
Bluerock Residential Growth REIT, Inc., Series D	7.13%			28	634,571	0.1
					1,112,580	0.1
REITS – EINZELHANDEL						
Cedar Realty Trust, Inc., Series B(d)	7.25%			36	544,570	0.0
					1,657,150	0.1
STAMMAKTIEN						
ENERGIE						
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE						
Battalion Oil Corp.				1	6	0.0
Keyera Corp. (d)				67,430	1,068,615	0.1
Paragon Offshore Ltd. - Class A (d)				152	15	0.0
Paragon Offshore Ltd. - Class B (d)				228	1,368	0.0
Vantage Drilling International				203	1,167	0.0
					1,071,171	0.1
VERBRAUCHSGÜTER						
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL						
Southeastern Grocers, Inc. Npv (d)				1,094	35,008	0.0
NICHT-BASISKONSUMGÜTER						
KFZ-BESTANDTEILE						
ATD New Holdings, Inc. (d)				1,384	20,241	0.0
INDUSTRIEGÜTER						
CONSTRUCTION & ENGINEERING						
Willscot Corp. (d)				556	7,417	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
SOFTWARE					
Monitronics International, Inc. (d)			746	$ 2,153	0.0%
Monitronics International, Inc.			743	2,229	0.0
				4,382	0.0
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
MEDIEN					
iHeartMedia, Inc. - Class A			176	1,531	0.0
GRUNDSTOFFE					
METALL UND BERGBAU					
BIS Industries Holdings Ltd. (d)			8,912	0	0.0
				1,139,750	0.1
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
MEXIKO					
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	USD 855	751,331	0.1
VENEZUELA					
Petroleos de Venezuela SA(c)	5.38%	04/12/2027	110	3,465	0.0
				754,796	0.1
COLLATERALIZED LOAN OBLIGATIONS					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-31A, Class C(f)	3.84%	04/20/2031	250	246,946	0.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Lloyds Banking Group PLC(a)	6.00%	06/07/2032	GBP 33	38,677	0.0
PNC Financial Services Group, Inc. (The), Series R(a)	4.85%	06/01/2023	USD 120	113,700	0.0
				152,377	0.0
INDUSTRIE					
Glencore Finance Canada Ltd.	6.00%	11/15/2041	9	9,947	0.0
TCI Communications, Inc.	7.88%	02/15/2026	60	80,255	0.0
				90,202	0.0
				242,579	0.0
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-LC9, Class G	4.42%	12/15/2047	171	120,535	0.0
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class E(f)	4.93%	05/15/2036	34	24,173	0.0
				144,708	0.0
BANKDARLEHEN					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Mallinckrodt International Finance S.A.(f)	4.20%	09/24/2024	30	20,471	0.0
ENERGIE					
California Resources Corporation(f)	11.38%	12/31/2021	16	744	0.0
				21,215	0.0
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
VENEZUELA					
Venezuela Government International Bond(c)	9.00%	05/07/2023	4	193	0.0
Venezuela Government International Bond(c)	9.25%	09/15/2027	219	12,045	0.0
				12,238	0.0
OPTIONSSCHEINE					
iHeart Media, Inc., expiring 05/01/2039(d)			1,319	9,892	0.0
Willscot Corp., expiring 11/29/2022(d)			861	2,262	0.0
				12,154	0.0
GEMEINDEVERWALTUNG – REGIONALANLEIHEN					
ARGENTINIEN					
Provincia de Buenos Aires/Government Bonds(f)	29.81%	05/31/2022	ARS 800	5,310	0.0
				16,079,682	1.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Gesamtanlagen					
(Kosten $1,087,026,071)				$ 1,036,484,950	82.5%
Termineinlagen					
ANZ, London(i)	0.01 %	–		112,019	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(i)	0.01 %	–		66,181,130	5.2
Bank of Nova Scotia, Toronto(i)	0.04 %	–		67,667	0.0
BBH, Grand Cayman(i)	(0.60)%	–		24,900	0.0
BBH, Grand Cayman(i)	0.01 %	–		28,790	0.0
BBH, Grand Cayman(i)	0.03 %	–		796,180	0.1
BBH, Grand Cayman(i)	2.75 %	–		33,665	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(i)	(1.39)%	–		41,601	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(i)	(0.67)%	–		6,469,427	0.5
National Australia Bank, London(i)	0.01 %	–		64,709	0.0
Nordea Bank Abp, Oslo(i)	(0.25)%	–		152,231	0.0
Sumitomo, London(i)	(0.26)%	–		707,074	0.1
Sumitomo, London(i)	0.01 %	–		2,121,380	0.2
Sumitomo, Tokyo(i)	0.01 %	–		125,328,897	10.0
SEB, Stockholm(i)	(0.30)%	–		303,327	0.0
Termineinlagen insgesamt				202,432,997	16.1
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				17,369,241	1.4
Nettovermögen				$ 1,256,287,188	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
10 Yr Australian Bond Futures	06/15/2020	7	$ 694,512	$ 695,069	$ 557
FTSE 100 Index Futures	06/19/2020	102	7,310,430	7,634,411	323,981
Japan 10 Yr Bond (OSE) Futures	06/15/2020	6	8,488,386	8,467,708	(20,678)
OMXS 30 Index Futures	06/18/2020	864	14,377,743	14,927,934	550,191
S&P 500 E-Mini Futures	06/19/2020	203	29,402,234	30,876,300	1,474,066
S&P/TSX 60 IX Futures	06/18/2020	8	1,038,698	1,064,110	25,412
SPI 200 Index Futures	06/18/2020	217	19,016,654	20,788,577	1,771,923
TOPIX Index Futures	06/11/2020	18	2,428,764	2,602,068	173,304
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	17	2,132,969	2,135,625	2,656
Short					
10 Yr Canadian Bond Futures	09/21/2020	44	4,905,640	4,909,874	(4,234)
Euro STOXX 50 Index Futures	06/19/2020	257	7,557,885	8,689,715	(1,131,830)
Euro-Bund Futures	06/08/2020	37	7,166,860	7,083,251	83,609
Hang Seng Index Futures	06/29/2020	45	6,535,763	6,609,076	(73,313)
Long Gilt Futures	09/28/2020	24	4,071,647	4,073,722	(2,075)
MSCI Singapore IX ETS Futures	06/29/2020	337	6,928,203	6,869,762	58,441
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2020	831	115,167,266	115,560,938	(393,672)
					$ 2,838,338
				Wertsteigerung	$ 4,464,140
				Wertminderung	$ (1,625,802)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	AUD	1,509	USD	1,003	06/15/2020	$ (2,802)
Bank of America, NA.	CAD	1,237	USD	929	06/15/2020	30,861
Bank of America, NA.	EUR	993	USD	1,114	06/15/2020	11,475
Bank of America, NA.	GBP	1,602	USD	2,060	06/15/2020	81,434
Bank of America, NA.	JPY	138,244	USD	1,268	06/15/2020	(13,917)
Bank of America, NA.	NOK	10,604	USD	1,118	06/15/2020	26,842
Bank of America, NA.	SEK	5,030	USD	525	06/15/2020	(8,521)
Bank of America, NA.	SEK	8,146	USD	867	06/15/2020	2,867
Bank of America, NA.	USD	1,257	CAD	1,752	06/15/2020	15,414
Bank of America, NA.	USD	773	CHF	739	06/15/2020	(4,239)
Barclays Bank PLC	CAD	1,133	USD	813	06/15/2020	(9,858)
Barclays Bank PLC	CHF	2,371	USD	2,565	06/15/2020	98,939
Barclays Bank PLC	DKK	3,937	USD	589	06/15/2020	2,718
Barclays Bank PLC	EUR	1,045	USD	1,156	06/15/2020	(4,062)
Barclays Bank PLC	GBP	551	USD	714	06/15/2020	33,036
Barclays Bank PLC	SGD	1,604	USD	1,133	06/15/2020	(2,596)
Barclays Bank PLC	USD	1,824	AUD	3,018	06/15/2020	187,831
Barclays Bank PLC	USD	532	CAD	752	06/15/2020	14,709
Barclays Bank PLC	USD	3,110	EUR	2,794	06/15/2020	(8,206)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC	USD	2,670	GBP	2,138	06/15/2020	$ (30,099)
Barclays Bank PLC	AUD	9,213	USD	6,064	06/17/2020	(77,477)
Barclays Bank PLC	CHF	2,370	USD	2,444	06/17/2020	(21,599)
Barclays Bank PLC	USD	4,189	SEK	40,354	06/17/2020	94,299
Barclays Bank PLC	USD	4,957	MXN	120,141	06/19/2020	446,522
Barclays Bank PLC	RUB	148,811	USD	2,035	07/14/2020	(63,962)
Barclays Bank PLC	USD	1,601	IDR	23,903,349	07/23/2020	14,493
Barclays Bank PLC	USD	2,064	INR	157,164	07/23/2020	6,687
Barclays Bank PLC	HUF	464,440	USD	1,429	07/29/2020	(55,846)
Barclays Bank PLC	USD	6,795	PHP	346,389	08/19/2020	31,802
Barclays Bank PLC	USD	1,402	CNY	10,064	08/20/2020	2,869
BNP Paribas SA	USD	21,360	BRL	114,865	06/02/2020	165,313
BNP Paribas SA	EUR	1,964	USD	2,166	06/15/2020	(15,163)
BNP Paribas SA	BRL	114,865	USD	21,326	07/02/2020	(164,385)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	269	USD	293	06/10/2020	(5,520)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	1,199	EUR	1,108	06/10/2020	31,526
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	3,029	USD	1,961	06/15/2020	(57,630)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	739	USD	558	06/15/2020	20,962
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	1,650	USD	1,181	06/15/2020	(17,561)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	220	USD	227	06/15/2020	(1,580)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	545	USD	576	06/15/2020	8,703
Brown Brothers Harriman & Co.	DKK	1,815	USD	272	06/15/2020	1,357
Brown Brothers Harriman & Co.	DKK	27,460	USD	4,000	06/15/2020	(90,324)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	442	USD	496	06/15/2020	5,125
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	3,535	USD	3,847	06/15/2020	(77,595)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	679	USD	838	06/15/2020	(1,089)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	1,577	USD	1,998	06/15/2020	50,020
Brown Brothers Harriman & Co.	HKD	6,994	USD	902	06/15/2020	(341)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	54,805	USD	510	06/15/2020	1,910
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	140,592	USD	1,281	06/15/2020	(22,403)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	3,707	USD	155	06/15/2020	(12,253)
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	23,948	USD	2,408	06/15/2020	(134,049)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	1,629	AUD	2,643	06/15/2020	133,281
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	1,222	CAD	1,722	06/15/2020	28,814
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	330	CHF	306	06/15/2020	(11,497)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	481	CHF	469	06/15/2020	6,893
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	681	DKK	4,503	06/15/2020	(9,880)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	743	DKK	5,067	06/15/2020	11,263
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	487	EUR	430	06/15/2020	(9,248)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	5,091	EUR	4,689	06/15/2020	115,193
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	1,387	GBP	1,114	06/15/2020	(11,505)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	932	GBP	777	06/15/2020	27,346
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	468	ILS	1,655	06/15/2020	3,115
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	730	JPY	77,626	06/15/2020	(10,012)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	449	NOK	4,757	06/15/2020	40,190
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	640	SEK	6,427	06/15/2020	42,283
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	2,003	USD	109	06/15/2020	(5,267)
Brown Brothers Harriman & Co.	TRY	3,531	USD	519	06/30/2020	6,278
Brown Brothers Harriman & Co.	THB	108,956	USD	3,412	08/27/2020	(12,467)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	637	USD	419	09/14/2020	(5,581)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	530	USD	383	09/14/2020	(1,629)
Brown Brothers Harriman & Co.	DKK	2,186	USD	321	09/14/2020	(4,947)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	956	USD	1,046	09/14/2020	(17,377)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	62,812	AUD	96,913	06/12/2020	1,786,014
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	25,100	CAD	35,104	06/12/2020	395,416
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	29	CHF	28	06/12/2020	271
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14,415	EUR	13,307	06/12/2020	359,102
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	43,976	JPY	4,720,890	06/12/2020	(196,568)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	21,079	NZD	34,628	06/12/2020	415,140
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	782	SGD	1,108	06/12/2020	2,152
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	7,571	ZAR	139,551	06/12/2020	372,194
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	29	CNH	207	06/22/2020	(56)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	24,204	GBP	19,707	06/22/2020	135,754
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	56,002	AUD	84,622	06/30/2020	404,303
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14,767	EUR	13,409	06/30/2020	125,640
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	24,204	GBP	19,705	06/30/2020	134,453
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	698	SGD	990	06/30/2020	2,817
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6,571	ZAR	114,597	06/30/2020	(60,827)
Citibank, NA	USD	1,966	BRL	10,626	06/02/2020	25,128
Citibank, NA	EUR	1,675	USD	1,831	06/10/2020	(28,564)
Citibank, NA	USD	900	EUR	820	06/10/2020	10,477
Citibank, NA	AUD	951	USD	643	06/15/2020	9,429
Citibank, NA	CAD	1,690	USD	1,197	06/15/2020	(30,546)
Citibank, NA	EUR	506	USD	566	06/15/2020	3,918

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citibank, NA	EUR	3,791	USD	4,178	06/15/2020	$ (31,255)
Citibank, NA	GBP	550	USD	675	06/15/2020	(4,855)
Citibank, NA	GBP	16,537	USD	20,871	06/15/2020	447,269
Citibank, NA	ILS	21,161	USD	6,036	06/15/2020	8,862
Citibank, NA	SEK	15,989	USD	1,636	06/15/2020	(61,011)
Citibank, NA	USD	1,102	AUD	1,851	06/15/2020	132,052
Citibank, NA	USD	812	CAD	1,118	06/15/2020	(132)
Citibank, NA	USD	3,907	EUR	3,553	06/15/2020	37,870
Citibank, NA	USD	2,261	EUR	1,981	06/15/2020	(61,285)
Citibank, NA	USD	1,700	GBP	1,368	06/15/2020	(10,020)
Citibank, NA	USD	641	GBP	531	06/15/2020	15,252
Citibank, NA	CLP	7,849,432	USD	9,395	07/15/2020	(412,315)
Citibank, NA	COP	25,704,549	USD	6,537	07/15/2020	(327,628)
Citibank, NA	USD	3,195	COP	12,507,570	07/15/2020	144,624
Citibank, NA	USD	2,297	INR	179,444	07/23/2020	67,044
Credit Suisse International	USD	588	SEK	5,723	06/15/2020	19,941
Credit Suisse International	USD	10,448	NZD	17,374	06/17/2020	335,966
Credit Suisse International	USD	558	ZAR	9,750	07/17/2020	(5,189)
Credit Suisse International	CZK	70,210	USD	2,818	07/29/2020	(78,765)
Deutsche Bank AG	EUR	472	USD	531	06/15/2020	6,255
Deutsche Bank AG	GBP	475	USD	622	06/15/2020	35,333
Deutsche Bank AG	NOK	16,599	USD	1,623	06/15/2020	(85,148)
Deutsche Bank AG	PEN	11,815	USD	3,452	07/15/2020	6,976
Deutsche Bank AG	PEN	7,300	USD	2,111	07/15/2020	(17,477)
Deutsche Bank AG	USD	1,584	PEN	5,431	07/15/2020	32
Goldman Sachs International	CAD	1,510	USD	1,124	06/15/2020	27,247
Goldman Sachs International	EUR	21,552	USD	23,446	06/15/2020	(484,381)
Goldman Sachs International	HKD	10,171	USD	1,312	06/15/2020	(63)
Goldman Sachs International	JPY	59,424	USD	535	06/15/2020	(15,719)
Goldman Sachs International	JPY	1,525,309	USD	14,214	06/15/2020	67,874
Goldman Sachs International	USD	1,424	CAD	2,052	06/15/2020	66,010
Goldman Sachs International	USD	922	JPY	94,918	06/15/2020	(41,650)
Goldman Sachs International	GBP	1,052	USD	1,286	06/17/2020	(13,380)
Goldman Sachs International	NOK	23,898	USD	2,412	06/17/2020	(46,839)
Goldman Sachs International	USD	4,036	CAD	5,565	06/17/2020	6,241
Goldman Sachs International	USD	2,490	EUR	2,267	06/17/2020	27,636
Goldman Sachs International	MXN	189,338	USD	7,692	06/19/2020	(824,713)
Goldman Sachs International	USD	1,087	MXN	24,272	06/19/2020	4,698
Goldman Sachs International	USD	592	RUB	42,270	07/14/2020	4,461
Goldman Sachs International	ZAR	27,347	USD	1,491	07/17/2020	(59,783)
Goldman Sachs International	CZK	15,459	USD	630	07/29/2020	(8,035)
Goldman Sachs International	PHP	473,315	USD	9,264	08/19/2020	(64,779)
HSBC Bank USA	AUD	11,726	USD	7,757	06/15/2020	(59,224)
HSBC Bank USA	DKK	8,819	USD	1,359	06/15/2020	45,326
HSBC Bank USA	GBP	447	USD	572	06/15/2020	20,217
HSBC Bank USA	ILS	2,368	USD	672	06/15/2020	(2,375)
HSBC Bank USA	USD	1,380	GBP	1,172	06/15/2020	67,744
JPMorgan Chase Bank, NA	CAD	6,768	USD	4,851	06/15/2020	(64,721)
JPMorgan Chase Bank, NA	CAD	8,907	USD	6,576	06/15/2020	107,202
JPMorgan Chase Bank, NA	CHF	495	USD	507	06/15/2020	(7,707)
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	13,339	USD	15,361	06/15/2020	549,825
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	1,051	USD	1,145	06/15/2020	(21,671)
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	518	USD	667	06/15/2020	26,531
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	770	USD	904	06/15/2020	(47,429)
JPMorgan Chase Bank, NA	SGD	1,187	USD	837	06/15/2020	(3,689)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	885	CAD	1,251	06/15/2020	23,796
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	2,602	EUR	2,354	06/15/2020	11,128
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	3,081	JPY	331,411	06/15/2020	(7,271)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	726	JPY	80,455	06/15/2020	20,414
JPMorgan Chase Bank, NA	AUD	12,153	USD	7,885	06/17/2020	(215,404)
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	2,267	USD	2,462	06/17/2020	(54,858)
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	1,631	USD	1,987	06/17/2020	(26,877)
JPMorgan Chase Bank, NA	JPY	548,012	USD	5,100	06/17/2020	17,358
JPMorgan Chase Bank, NA	NOK	80,143	USD	7,924	06/17/2020	(321,562)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	4,845	CHF	4,695	06/17/2020	38,442
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	3,940	JPY	424,620	06/17/2020	(1,903)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	7,416	SEK	72,581	06/17/2020	288,036
JPMorgan Chase Bank, NA	MXN	53,915	USD	2,275	06/19/2020	(150,049)
JPMorgan Chase Bank, NA	COP	1,126,890	USD	301	07/15/2020	294
JPMorgan Chase Bank, NA	COP	10,185,829	USD	2,643	07/15/2020	(77,041)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	5,980	ZAR	110,661	07/17/2020	294,517
JPMorgan Chase Bank, NA	ZAR	64,140	USD	3,466	07/17/2020	(170,704)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	2,984	IDR	47,799,798	07/23/2020	247,246
JPMorgan Chase Bank, NA	CZK	34,034	USD	1,340	07/29/2020	(64,743)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	1,466	HUF	464,440	07/29/2020	$ 18,860
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	41	KRW	49,784	08/13/2020	(844)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	1,840	CNY	13,243	08/20/2020	9,286
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	1,951	TWD	57,771	08/20/2020	(12,304)
Morgan Stanley & Co., Inc.	EUR	848	USD	927	06/15/2020	(14,963)
Morgan Stanley & Co., Inc.	JPY	946,577	USD	9,284	06/15/2020	505,341
Morgan Stanley & Co., Inc.	NZD	1,513	USD	916	06/15/2020	(23,353)
Morgan Stanley & Co., Inc.	SEK	5,444	USD	572	06/15/2020	(6,071)
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD	2,404	EUR	2,224	06/15/2020	65,076
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD	1,302	GBP	1,008	06/15/2020	(57,436)
Morgan Stanley & Co., Inc.	RUB	162,851	USD	2,181	07/14/2020	(116,024)
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD	4,167	RUB	311,161	07/14/2020	221,688
Morgan Stanley & Co., Inc.	IDR	142,247,869	USD	8,888	07/23/2020	(727,461)
Morgan Stanley & Co., Inc.	USD	185	IDR	2,800,167	07/23/2020	4,202
Royal Bank of Scotland PLC	CHF	11,253	USD	11,627	06/15/2020	(76,946)
Royal Bank of Scotland PLC	DKK	13,297	USD	1,939	06/15/2020	(41,327)
Royal Bank of Scotland PLC	GBP	592	USD	765	06/15/2020	33,999
Royal Bank of Scotland PLC	USD	965	AUD	1,490	06/15/2020	28,433
Royal Bank of Scotland PLC	USD	1,286	EUR	1,167	06/15/2020	9,362
Standard Chartered Bank	AUD	1,000	USD	669	06/15/2020	2,791
Standard Chartered Bank	EUR	460	USD	508	06/15/2020	(3,334)
UBS AG	BRL	125,491	USD	22,241	06/02/2020	(1,275,764)
UBS AG	EUR	5,001	USD	5,410	06/10/2020	(142,750)
UBS AG	AUD	4,481	USD	2,918	06/15/2020	(68,935)
UBS AG	GBP	548	USD	714	06/15/2020	37,358
UBS AG	USD	1,434	CAD	2,044	06/15/2020	50,642
UBS AG	PLN	2,295	USD	571	07/29/2020	(735)
						$ 2,352,390
					Wertsteigerung	$ 10,191,335
					Wertminderung	$ (7,838,945)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

VERKAUFTE KAUFOPTIONEN

Bezeichnung	Ausübungspreis		Fälligkeit	Kontrakte	Prämien erhalten	Marktwert
FTSE 100 Index(k)	GBP	5,950	6/19/20	340	$ 79,143	$ (139,111)
FTSE 100 Index (k)		5,950	6/19/20	320	74,803	(130,928)
Nikkei 225 Index (k)	JPY	20,375	6/12/20	4,000	17,548	(59,669)
Nikkei 225 Index (k)		20,375	6/12/20	22,000	90,959	(328,176)
Nikkei 225 Index (k)		22,250	6/12/20	10,000	6,028	(22,765)
Nikkei 225 Index (k)		22,250	6/12/20	7,000	5,193	(15,935)
S&P 500 Index (k)	USD	2,900	6/19/20	1,620	137,854	(383,240)
S&P 500 Index (k)		2,940	6/19/20	11,600	883,047	(1,618,776)
S&P 500 Index (k)		2,900	6/19/20	1,480	117,818	(350,120)
S&P 500 Index (k)		2,940	6/19/20	11,600	963,314	(1,618,776)
					$ 2,375,707	$ (4,667,496)

VERKAUFTE VERKAUFSOPTIONEN

Bezeichnung	Ausübungspreis		Fälligkeit	Kontrakte	Prämien erhalten	Marktwert
FTSE 100 Index (k)	GBP	5,950	6/19/20	340	$ 66,548	$ (26,782)
FTSE 100 Index (k)		5,950	6/19/20	320	60,542	(25,206)
Nikkei 225 Index (k)	JPY	19,750	6/12/20	4,000	26,042	(2,033)
Nikkei 225 Index (k)		19,750	6/12/20	22,000	170,806	(11,179)
Nikkei 225 Index (k)		20,125	6/12/20	10,000	10,758	(6,787)
Nikkei 225 Index (k)		20,125	6/12/20	7,000	6,491	(4,751)
S&P 500 Index (k)	USD	2,900	6/19/20	1,620	197,794	(48,760)
S&P 500 Index (k)		2,940	6/19/20	11,600	1,309,780	(417,972)
S&P 500 Index (k)		2,900	6/19/20	1,480	184,338	(44,546)
S&P 500 Index (k)		2,940	6/19/20	11,600	1,081,555	(417,972)
					$ 3,114,654	$ (1,005,988)

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 31, 5 Year Index	06/20/2025	USD 13,635	$ 319,672	$ (337,116)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 33, 5 Year Index	12/20/2024	69,032	(1,640,442)	(7,487,274)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Federative Republic of Brazil	06/20/2025	272	(23,466)	(2,197)
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 33, 5 Year Index	06/20/2025	EUR 13,978	476,650	662,542
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Republic of Turkey	06/20/2025	USD 141	(27,414)	(3,401)
Insgesamt				$ (895,000)	$ (7,167,446)
				Wertsteigerung	$ 662,542
				Wertminderung	$ (7,829,988)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal-betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 850	05/07/2050	0.870%	3 Month LIBOR	$ 15,805
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CNY 10,900	02/17/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.547%	41,518
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	32,439	02/20/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.598%	134,142
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	32,921	02/21/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.620%	140,882
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	65,190	02/26/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.496%	227,741
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 2,850	10/21/2029	3 Month CDOR	1.967%	187,823
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP 1,520	10/22/2029	6 Month LIBOR	0.928%	92,585
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 2,520	10/23/2029	6 Month BBSW	1.312%	72,073
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 1,430	11/06/2029	3 Month CDOR	1.995%	97,211
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 1,910	11/07/2029	6 Month BBSW	1.420%	67,375
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 1,000	11/22/2029	3 Month CDOR	1.903%	62,005
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 1,300	11/25/2029	6 Month BBSW	1.258%	32,790
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 830	12/02/2029	3 Month CDOR	1.968%	55,091
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP 580	12/03/2029	6 Month LIBOR	0.947%	37,813
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 900	12/04/2029	6 Month BBSW	1.290%	24,400
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 1,050	12/20/2029	3 Month CDOR	2.086%	77,890
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 2,680	12/24/2029	1.780%	3 Month BKBM	3,124
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 1,540	12/24/2029	6 Month BBSW	1.480%	59,422
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 2,680	12/24/2029	3 Month BKBM	1.780%	164,715
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 97,690	01/07/2030	6 Month LIBOR	0.132%	12,060
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 1,450	01/09/2030	6 Month BBSW	1.320%	41,090
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 1,300	01/09/2030	3 Month CDOR	2.059%	94,762
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP 730	01/14/2030	6 Month LIBOR	0.915%	44,762
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 1,810	01/17/2030	3 Month CDOR	2.027%	128,193
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,300	01/21/2030	1.970%	3 Month CDOR	(87,069)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 2,750	01/22/2030	6 Month BBSW	1.293%	72,892
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 3,180	01/22/2030	3 Month CDOR	1.933%	204,974
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR 510	01/23/2030	6 Month EURIBOR	0.131%	15,554
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 1,430	01/23/2030	6 Month BBSW	1.275%	36,244
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR 1,420	01/24/2030	6 Month EURIBOR	0.104%	39,102
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 2,040	01/24/2030	3 Month LIBOR	1.730%	212,964
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,020	01/27/2030	3 Month LIBOR	1.681%	101,727
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR 1,390	01/28/2030	6 Month EURIBOR	0.067%	32,734
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 1,710	01/28/2030	6 Month BBSW	1.208%	35,906
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 2,140	01/28/2030	3 Month LIBOR	1.641%	205,687
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP 910	01/31/2030	6 Month LIBOR	0.738%	36,549
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	SEK 2,590	02/03/2030	3 Month STIBOR	0.459%	2,588
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 1,640	02/03/2030	1.405%	3 Month BKBM	2,658
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,640	02/03/2030	3 Month BKBM	1.405%	65,304
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 2,080	02/03/2030	3 Month LIBOR	1.496%	172,258
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 125,800	02/04/2030	6 Month LIBOR	0.021%	2,913
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR 1,770	02/04/2030	6 Month EURIBOR	(0.031)%	22,836
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 2,290	02/04/2030	3 Month CDOR	1.783%	124,318
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	2,520	02/06/2030	3 Month CDOR	1.824%	143,885
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 2,410	02/06/2030	3 Month LIBOR	1.559%	214,323
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 2,110	02/07/2030	6 Month LIBOR	(0.332)%	6,840
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 1,360	02/07/2030	3 Month LIBOR	1.607%	127,357
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR 3,470	02/10/2030	6 Month EURIBOR	0.003%	57,637
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 4,900	02/10/2030	6 Month BBSW	1.173%	90,838
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 6,860	02/10/2030	3 Month LIBOR	1.602%	639,796

Clearing-Broker/(Börse)		Nominal-betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY	113,850	02/12/2030	6 Month LIBOR	0.043%	$ 4,840
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD	1,310	02/12/2030	3 Month LIBOR	1.495%	108,704
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)		1,480	02/14/2030	3 Month LIBOR	1.582%	135,242
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP	1,010	02/18/2030	6 Month LIBOR	0.798%	47,698
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD	1,980	02/18/2030	3 Month CDOR	1.757%	104,335
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD	3,860	02/18/2030	3 Month LIBOR	1.528%	333,210
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD	2,970	02/19/2030	6 Month BBSW	1.169%	53,798
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD	2,790	02/20/2030	3 Month LIBOR	1.508%	235,687
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)		2,540	02/24/2030	3 Month LIBOR	1.465%	204,226
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR	2,530	02/25/2030	6 Month EURIBOR	(0.103)%	12,583
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD	1,120	02/25/2030	3 Month CDOR	1.573%	44,850
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP	370	02/26/2030	6 Month LIBOR	0.691%	12,787
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD	1,190	02/27/2030	3 Month LIBOR	1.262%	72,310
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR	520	02/28/2030	6 Month EURIBOR	(0.117)%	1,807
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD	1,630	03/02/2030	3 Month LIBOR	1.245%	96,320
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF	2,070	03/03/2030	6 Month LIBOR	(0.538)%	(38,141)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)		1,800	03/12/2030	6 Month LIBOR	(0.576)%	(40,002)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NOK	900	03/30/2030	6 Month NIBOR	1.283%	4,240
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	SEK	15,080	03/30/2030	3 Month STIBOR	0.519%	23,700
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)		15,810	04/16/2030	3 Month STIBOR	0.476%	17,355
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF	2,430	05/05/2030	6 Month LIBOR	(0.335)%	3,795
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR	1,860	06/01/2030	6 Month EURIBOR	(0.112)%	3,868
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD	7,020	06/01/2030	3 Month LIBOR	0.692%	33,908
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD	100	06/02/2030	0.718%	3 Month BKBM	191
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF	2,060	06/02/2030	6 Month LIBOR	(0.337)%	2,583
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY	44,970	03/29/2038	6 Month LIBOR	0.674%	37,920
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)		107,240	07/17/2038	6 Month LIBOR	0.652%	91,973
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)		30,310	11/16/2038	6 Month LIBOR	0.732%	30,423
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)		53,350	02/07/2039	6 Month LIBOR	0.496%	32,055
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)		48,990	03/20/2039	6 Month LIBOR	0.471%	27,449
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)		870,350	03/10/2040	6 Month LIBOR	0.015%	(234,443)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD	950	03/27/2048	3 Month CDOR	2.700%	224,483
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD	1,180	03/28/2048	6 Month BBSW	3.078%	390,251
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD	240	11/14/2048	3 Month CDOR	2.971%	67,002
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD	260	11/15/2048	6 Month BBSW	3.114%	87,825
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD	360	02/04/2049	3 Month CDOR	2.696%	83,170
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD	320	02/06/2049	6 Month BBSW	2.743%	88,301
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD	270	03/15/2049	3 Month CDOR	2.482%	52,026
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD	300	03/19/2049	6 Month BBSW	2.535%	72,315
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD	6,980	03/09/2050	3 Month LIBOR	1.160%	431,009
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR	4,940	03/10/2050	6 Month EURIBOR	0.012%	(38,087)
Insgesamt						$ 7,419,653
					Wertsteigerung	$ 7,857,395
					Wertminderung	$ (437,742)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Markt-wert	Vorab-gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 1,200	$ (608,160)	$ (172,043)	$ (436,117)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,000	(506,800)	(142,137)	(364,663)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	770	(390,236)	(110,690)	(279,546)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,800	(602,100)	(114,905)	(487,195)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,916	(2,491,429)	(692,381)	(1,799,048)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,300	(769,350)	(144,478)	(624,872)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,451	(1,242,167)	(347,508)	(894,659)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,000	(2,341,500)	(358,538)	(1,982,962)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	163	(82,608)	(81,475)	(1,133)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	88	(44,598)	(16,960)	(27,638)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	88	(44,598)	(16,880)	(27,718)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	44	(22,299)	(8,413)	(13,886)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	88	(44,598)	(16,535)	(28,063)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	250	(83,625)	(31,182)	(52,443)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,000	(1,013,600)	(308,347)	(705,253)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	300	(152,040)	(70,143)	(81,897)

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss-datum	Nomineller Betrag (000)	Markt-wert	Vorab-gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 330	$ (167,244)	$ (66,062)	$ (101,182)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	900	(301,050)	(142,577)	(158,473)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	400	(133,800)	(54,259)	(79,541)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	264	(133,795)	(52,068)	(81,727)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	132	(66,898)	(26,118)	(40,780)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	850	(284,325)	(103,367)	(180,958)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,200	(401,400)	(169,277)	(232,123)
Goldman Sachs International	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	30	(5,485)	1,373	(6,858)
Goldman Sachs International	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	20	(3,657)	1,432	(5,089)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	33	(16,725)	(16,473)	(252)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	33	(16,724)	(16,473)	(251)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	200	(66,900)	(24,014)	(42,886)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	500	(253,400)	(135,860)	(117,540)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	830	(277,635)	(114,708)	(162,927)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	450	(150,525)	(43,749)	(106,776)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	88	(44,598)	(17,149)	(27,449)
JPMorgan Chase Bank, NA	Intrum AB	06/20/2025	EUR 104	(16,851)	(17,144)	2.3
JPMorgan Chase Bank, NA	Intrum AB	06/20/2025	105	(17,013)	(18,443)	1,430
JPMorgan Chase Bank, NA	Intrum AB	06/20/2025	209	(33,864)	(36,710)	2,846
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,394	(1,213,279)	(340,540)	(872,739)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	348	(176,366)	(65,499)	(110,867)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	337	(170,792)	(63,850)	(106,942)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	54	(27,367)	(10,448)	(16,919)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	36	(18,245)	(7,010)	(11,235)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	87	(44,092)	(16,688)	(27,404)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	87	(44,092)	(16,622)	(27,470)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	460	(153,870)	(54,817)	(99,053)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	150	(50,175)	(12,623)	(37,552)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	500	(253,400)	(120,931)	(132,469)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	257	(130,248)	(50,319)	(79,929)
JPMorgan Securities LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	300	(100,350)	(34,112)	(66,238)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	66	(33,449)	(32,245)	(1,204)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	204	(103,387)	(94,062)	(9,325)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,000	(1,013,600)	(334,948)	(678,652)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	204	(103,387)	(86,415)	(16,972)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	203	(102,880)	(84,978)	(17,902)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	204	(103,387)	(85,905)	(17,482)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	204	(103,387)	(86,922)	(16,465)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,000	(506,800)	(209,083)	(297,717)
Insgesamt				$ (17,284,150)	$ (5,492,278)	$ (11,791,872)
					Wertsteigerung	$ 4,569
					Wertminderung	$ (11,796,441)

INFLATIONSSWAPS

Kontrahent	Nomineller Betrag (000)	Abschluss-datum	Zinsart: Vom Fonds geleistete Zahlungen	Zinsart: Vom Fonds erhaltene Zahlungen	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	USD 6,510	01/05/2023	2.163%	CPI#	$ (313,109)

Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Goldman Sachs International					
GSABHY01	99,303	0.01%	USD 12,364	02/18/2021	$ (410,121)
IBXXC1D1	1,000,000	LIBOR Plus 0.00%	1,000	12/20/2020	307,606
IBXXC2D1	1,510,000	EURIBOR Plus 0.00%	EUR 1,510	12/20/2020	502,880
JPMorgan Chase Bank, NA					
JPABSAA1	30,320	0.14%	USD 3,006	05/29/2020	39,501
JPABSAA1	1,180,514	0.14%	117,045	05/29/2020	1,537,974
JPQABHY1	150,650	0.06%	17,930	02/18/2021	764,111
Insgesamt					$ 2,741,951
				Wertsteigerung	$ 3,152,072
				Wertminderung	$ (410,121)
Swaps insgesamt					$ (9,110,823)

(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) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

(e) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für Derivate zu dienen.

(f) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2020.

(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) Tagesgeld.

(k) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.

Währungskürzel:

ARS – Argentine Peso
AUD – Australian Dollar
BRL – Brazilian Real
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
CLP – Chilean Peso
CNY – Chinese Yuan Renminbi
COP – Colombian Peso
CZK – Czech Koruna
DKK – Danish Krone
DOP – Dominican Peso
EGP – Egyptian Pound
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
HKD – Hong Kong Dollar
HUF – Hungarian Forint
IDR – Indonesian Rupiah
ILS – Israeli Shekel
JPY – Japanese Yen
KRW – South Korean Won
MXN – Mexican Peso
NOK – Norwegian Krone
NZD – New Zealand Dollar
PEN – Peruvian Sol
PHP – Philippine Peso
RUB – Russian Ruble
SEK – Swedish Krona
SGD – Singapore Dollar
THB – Thailand Baht
TWD – New Taiwan Dollar
TRY – Turkish Lira
UAH – Ukrainian Hryvnia
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:
Collateralized Loan Obligations

	Anteile	Wert (CNH)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEN			
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of Hangzhou Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	153,600	¥ 1,397,760	0.2%
Bank of Hangzhou Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	793,900	7,237,634	0.8
Bank of Nanjing Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	169,100	1,335,890	0.2
Bank of Nanjing Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	867,200	6,863,344	0.7
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	65,400	2,211,828	0.2
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	485,363	16,444,840	1.7
China Minsheng Banking Corp., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	405,400	2,306,726	0.2
China Minsheng Banking Corp., Ltd. - Class A (Shanghai)	2,088,600	11,905,755	1.2
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	194,368	3,129,325	0.3
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	1,103,400	17,797,059	1.8
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	150,100	1,951,300	0.2
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	774,400	10,085,515	1.0
		82,666,976	8.5
KAPITALMÄRKTE			
China Galaxy Securities Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	78,100	765,380	0.1
China Galaxy Securities Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	400,300	3,930,077	0.4
China Merchants Securities Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	132,741	2,203,501	0.2
China Merchants Securities Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	685,000	11,391,687	1.2
CITIC Securities Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	164,700	3,667,869	0.4
CITIC Securities Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	874,656	19,514,026	2.0
Haitong Securities Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	287,000	3,314,850	0.3
Haitong Securities Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	1,477,600	17,097,329	1.7
		61,884,719	6.3
VERSICHERUNGEN			
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	95,600	6,759,876	0.7
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class A (Shanghai)	492,723	34,903,829	3.6
		41,663,705	4.3
		186,215,400	19.1
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Luxshare Precision Industry Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	123,010	5,473,945	0.6
Luxshare Precision Industry Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	633,753	28,253,316	2.9
Shengyi Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	183,600	4,920,480	0.5
Shengyi Technology Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	945,805	25,393,689	2.6
Shennan Circuits Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	27,460	4,146,460	0.4
Shennan Circuits Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	141,701	21,435,778	2.2
WUS Printed Circuit Kunshan Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	66,200	1,551,066	0.2
WUS Printed Circuit Kunshan Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	342,300	8,034,680	0.8
		99,209,414	10.2
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Beijing Sinnet Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	165,200	4,113,480	0.4
Beijing Sinnet Technology Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	851,600	21,243,418	2.2
Shanghai AtHub Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	24,400	1,847,080	0.2
Shanghai AtHub Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	125,400	9,510,050	1.0
		36,714,028	3.8
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
JCET Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	59,200	1,718,576	0.2
JCET Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	322,502	9,379,266	0.9
TongFu Microelectronics Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	21,400	501,830	0.1
TongFu Microelectronics Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	109,700	2,577,145	0.2
		14,176,817	1.4
		150,100,259	15.4
INDUSTRIEGÜTER			
BAUPRODUKTE			
Zhuzhou Kibing Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	5,900	34,220	0.0
Zhuzhou Kibing Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	1,890,400	10,984,267	1.1
		11,018,487	1.1
BAU- UND INGENIEURWESEN			
China Railway Group Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	222,800	1,169,700	0.1
China Railway Group Ltd. - Class A (Shanghai)	1,149,200	6,044,276	0.7
		7,213,976	0.8
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	14,200	2,066,526	0.2
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	73,300	10,686,756	1.1
		12,753,282	1.3

	Anteile	Wert (CNH)	Nettover-mögen %
MASCHINEN			
Sany Heavy Industry Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	206,600	¥ 3,786,978	0.4%
Sany Heavy Industry Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	1,066,200	19,579,001	2.0
Weichai Power Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	327,200	4,266,688	0.4
Weichai Power Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	1,683,060	21,987,031	2.3
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	873,903	5,566,762	0.6
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	4,498,400	28,706,940	2.9
		83,893,400	8.6
TRANSPORTWESEN – INFRASTRUKTUR			
Guangdong Provincial Expressway Development Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	401,927	2,753,200	0.3
Guangdong Provincial Expressway Development Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	2,066,765	14,183,097	1.5
		16,936,297	1.8
		131,815,442	13.6
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	3,844	5,253,211	0.5
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	21,867	29,937,809	3.1
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	31,500	1,993,635	0.2
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	162,518	10,304,477	1.1
Wuliangye Yibin Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	34,426	5,101,933	0.5
Wuliangye Yibin Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	177,631	26,372,807	2.7
		78,963,872	8.1
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Fujian Sunner Development Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	56,200	1,458,390	0.1
Fujian Sunner Development Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	291,100	7,567,788	0.8
Muyuan Foodstuff Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	12,800	1,538,432	0.2
Muyuan Foodstuff Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	66,000	7,946,972	0.8
New Hope Liuhe Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	87,450	2,450,349	0.3
New Hope Liuhe Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	449,500	12,617,904	1.3
		33,579,835	3.5
		112,543,707	11.6
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Huayu Automotive Systems Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	105,500	2,020,325	0.2
Huayu Automotive Systems Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	544,800	10,451,901	1.1
		12,472,226	1.3
KRAFTFAHRZEUGE			
Chongqing Changan Automobile Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	152,500	1,503,650	0.2
Chongqing Changan Automobile Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	787,900	7,782,828	0.8
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	344,080	3,182,740	0.3
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	1,774,354	16,442,634	1.7
SAIC Motor Corp., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	82,034	1,470,049	0.1
SAIC Motor Corp., Ltd. - Class A (Shanghai)	422,496	7,584,903	0.8
		37,966,804	3.9
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Shenzhen Overseas Chinese Town Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	129,100	753,944	0.1
Shenzhen Overseas Chinese Town Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	663,500	3,881,889	0.4
		4,635,833	0.5
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai - Class A (Nth SZ-SEHK)	14,200	808,548	0.1
Gree Electric Appliances, Inc. of Zhuhai - Class A (Shenzhen)	73,105	4,170,172	0.4
Haier Smart Home Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	129,813	2,148,405	0.2
Midea Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	56,400	3,328,728	0.4
Midea Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	290,700	17,188,328	1.8
Qingdao Haier Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	666,304	11,047,393	1.1
		38,691,574	4.0
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
China International Travel Service Corp., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	14,700	1,488,081	0.1
China International Travel Service Corp., Ltd. - Class A (Shanghai)	75,064	7,612,553	0.8
		9,100,634	0.9
		102,867,071	10.6
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
China National Medicines Corp., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	20,000	623,000	0.1
China National Medicines Corp., Ltd. - Class A (Shanghai)	103,162	3,219,343	0.3
Jointown Pharmaceutical Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	136,700	2,460,600	0.2
Jointown Pharmaceutical Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	702,400	12,666,202	1.3
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	90,000	1,602,000	0.2
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	461,617	8,231,731	0.8
		28,802,876	2.9

	Anteile	Wert (CNH)	Nettover-mögen %
PHARMAZEUTIKA			
Jiangsu Hengrui Medicine Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	37,200	¥ 2,927,640	0.3%
Jiangsu Hengrui Medicine Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	196,404	15,485,116	1.6
Joincare Pharmaceutical Group Industry Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	97,800	1,244,994	0.1
Joincare Pharmaceutical Group Industry Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	502,874	6,413,232	0.6
Livzon Pharmaceutical Group, Inc. - Class A (Nth SZ-SEHK)	39,500	1,573,285	0.2
Livzon Pharmaceutical Group, Inc. - Class A (Shenzhen)	203,100	8,104,190	0.8
Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	38,900	1,063,526	0.1
Shijiazhuang Yiling Pharmaceutical Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	200,100	5,480,687	0.6
Yifan Pharmaceutical Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	64,500	1,270,650	0.1
Yifan Pharmaceutical Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	333,200	6,575,982	0.7
Yunnan Baiyao Group Co. Ltd - Class A (Shenzhen)	95,100	8,401,174	0.9
Yunnan Baiyao Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	18,400	1,622,512	0.2
		60,162,988	6.2
		88,965,864	9.1
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Kingfa Sci & Tech Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	739,100	9,366,625	1.0
Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	440,700	1,568,892	0.2
Sinopec Shanghai Petrochemical Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	2,276,400	8,118,727	0.8
		19,054,244	2.0
BAUMATERIAL			
Anhui Conch Cement Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	67,980	3,861,264	0.4
Anhui Conch Cement Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	351,010	19,973,640	2.1
Guangdong Tapai Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	116,000	1,414,040	0.1
Guangdong Tapai Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	595,200	7,268,688	0.7
Huaxin Cement Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	31,700	787,745	0.1
Huaxin Cement Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	162,800	4,052,940	0.4
Tangshan Jidong Cement Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	61,000	1,058,960	0.1
Tangshan Jidong Cement Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	312,400	5,433,131	0.6
		43,850,408	4.5
PAPIER- UND HOLZPRODUKTE			
Shandong Chenming Paper Holdings Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	240,700	1,157,767	0.1
Shandong Chenming Paper Holdings Ltd. - Class A (Shenzhen)	1,241,900	5,984,407	0.6
		7,142,174	0.7
		70,046,826	7.2
IMMOBILIEN			
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Gemdale Corp. - Class A (Nth SSE-SEHK)	180,240	2,298,060	0.2
Gemdale Corp. - Class A (Shanghai)	1,187,700	15,170,725	1.6
Hangzhou Binjiang Real Estate Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	290,700	1,215,126	0.1
Hangzhou Binjiang Real Estate Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	1,499,700	6,280,151	0.7
Jinke Properties Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	170,600	1,313,620	0.1
Jinke Properties Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	881,600	6,800,670	0.7
Poly Developments and Holdings Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	265,400	3,811,144	0.4
Poly Developments and Holdings Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	1,366,700	19,661,517	2.0
		56,551,013	5.8
VERSORGUNG			
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
China Yangtze Power Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	185,000	3,217,150	0.3
China Yangtze Power Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	951,300	16,573,204	1.7
Huaneng Lancang River Hydropower, Inc. - Class A (Nth SSE-SEHK)	513,500	1,843,465	0.2
Huaneng Lancang River Hydropower, Inc. - Class A (Shanghai)	2,634,800	9,476,140	1.0
		31,109,959	3.2
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Oriental Pearl Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	126,400	1,264,000	0.1
Oriental Pearl Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	655,500	6,566,926	0.7
		7,830,926	0.8
UNTERHALTUNG			
Beijing Kunlun Tech Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	81,091	1,801,031	0.2
Beijing Kunlun Tech Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	419,000	9,322,920	0.9
G-bits Network Technology Xiamen Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	3,900	1,575,600	0.2
G-bits Network Technology Xiamen Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	20,031	8,107,247	0.8
		20,806,798	2.1
		28,637,724	2.9
Gesamtanlagen			
(Kosten ¥827,047,792)		¥958,853,265	98.5%

	Zinssatz	Datum	Wert (CNH)	Nettover-mögen %
Termineinlagen				
BBH, Grand Cayman(a)	(0.67)%	–	¥ 84,511	0.0%
BBH, Grand Cayman(a)	0.01 %	–	100,197	0.0
Termineinlagen insgesamt			184,708	0.0
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			14,271,553	1.5
Nettovermögen			¥973,309,526	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)	
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	67	AUD	14	06/30/2020	¥	46
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	2	AUD	1	06/30/2020		(7)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	63	CAD	12	06/30/2020		9
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	3	CAD	1	06/30/2020		(2)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	151	HKD	162	06/30/2020		(332)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	2	HKD	2	06/30/2020		2
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	63	NZD	14	06/30/2020		111
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	1	NZD	1	06/30/2020		(5)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	142	SGD	28	06/30/2020		362
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	1	SGD	1	06/30/2020		(7)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	2	USD	1	06/30/2020		4
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	226	USD	32	06/30/2020		(489)
						¥	(308)
					Wertsteigerung	¥	534
					Wertminderung	¥	(842)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
HKD – Hong Kong Dollar
NZD – New Zealand Dollar
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Australia & New Zealand Banking Group Ltd./United Kingdom(a)	6.75%	06/15/2026	USD	4,710	$ 5,252,863	2.6%
BNP Paribas SA(a)	6.75%	03/14/2022		6,845	7,038,865	3.5
Comerica, Inc.(a)	5.63%	07/01/2025		3,604	3,563,376	1.7
Cooperatieve Rabobank UA(a)	3.25%	12/29/2026	EUR	7,800	8,051,470	4.0
Credit Agricole SA(a)	8.13%	12/23/2025	USD	4,365	5,004,533	2.5
DNB Bank ASA(a)	4.88%	11/12/2024		8,010	7,726,766	3.8
Erste Group Bank AG(a)	6.50%	04/15/2024	EUR	7,000	8,066,205	4.0
HSBC Holdings PLC(a)	5.25%	09/16/2022		5,505	6,075,754	3.0
HSBC Holdings PLC(a)	6.38%	03/30/2025	USD	6,825	6,918,484	3.4
ING Groep NV(a)	5.75%	11/16/2026		7,775	7,570,906	3.7
ING Groep NV(a)	6.75%	04/16/2024		3,450	3,486,306	1.7
KBC Group NV(a)	4.25%	10/24/2025	EUR	4,400	4,675,448	2.3
Lloyds Banking Group PLC(a)	5.13%	12/27/2024	GBP	2,300	2,573,575	1.3
Lloyds Banking Group PLC(a)	7.50%	06/27/2024	USD	3,158	3,233,985	1.6
Lloyds Banking Group PLC(a)	7.50%	09/27/2025		2,160	2,217,133	1.1
Nationwide Building Society(a)	5.88%	12/20/2024	GBP	5,775	7,128,160	3.5
Nordea Bank Abp(a)	6.13%	09/23/2024	USD	4,980	4,982,249	2.5
Nordea Bank Abp(a)	6.63%	03/26/2026		3,224	3,431,019	1.7
Skandinaviska Enskilda Banken AB(a)	5.13%	05/13/2025		4,800	4,675,449	2.3
Svenska Handelsbanken AB(a)	5.25%	03/01/2021		4,325	4,333,010	2.1
Truist Financial Corp., Series P(a)	4.95%	09/01/2025		3,810	3,842,261	1.9
UBS Group AG(a)	6.88%	08/07/2025		10,973	11,543,513	5.7
UBS Group AG(a)	7.13%	08/10/2021		1,935	1,983,375	1.0
					123,374,705	60.9
MAKLER						
Charles Schwab Corp. (The), Series G(a)	5.38%	06/01/2025		2,183	2,291,338	1.1
VERSICHERUNGEN						
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR	4,713	4,958,122	2.5
					130,624,165	64.5
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(a)	5.88%	05/24/2022		8,600	9,236,244	4.6
Banco de Sabadell SA(a)	6.50%	05/18/2022		1,200	996,682	0.5
Banco Santander SA(a)	6.25%	09/11/2021		4,800	5,159,788	2.5
Banco Santander SA(a)	6.75%	04/25/2022		1,700	1,923,917	0.9
Bankia SA(a)	6.00%	07/18/2022		5,400	5,367,510	2.6
Credit Suisse Group AG(a)	6.38%	08/21/2026	USD	6,349	6,475,874	3.2
Credit Suisse Group AG(a)	7.50%	07/17/2023		5,519	5,689,089	2.8
Intesa Sanpaolo SpA(a)	3.75%	02/27/2025	EUR	7,410	6,400,132	3.2
Intesa Sanpaolo SpA(a)	7.75%	01/11/2027		2,830	3,298,897	1.6
Royal Bank of Scotland Group PLC, Series U(a) (b)	3.77%	09/30/2027	USD	2,900	2,622,124	1.3
Societe Generale SA(a)	7.38%	10/04/2023		7,175	7,019,209	3.5
Standard Chartered PLC(a) (b)	2.27%	01/30/2027		5,600	4,426,218	2.2
UniCredit SpA(a)	3.88%	06/03/2027	EUR	2,515	2,051,230	1.0
UniCredit SpA(a)	6.63%	06/03/2023		6,275	6,606,559	3.3
Unione di Banche Italiane SpA(a)	5.88%	01/20/2025		2,290	2,228,875	1.1
					69,502,348	34.3
Gesamtanlagen						
(Kosten $197,971,488)					$200,126,513	98.8%
Termineinlagen						
Bank of Nova Scotia, Toronto(c)	0.01 %	–			369,561	0.2
BBH, Grand Cayman(c)	(0.67)%	–			2,066	0.0
Sumitomo, London(c)	0.01 %	–			39,906	0.0
Termineinlagen insgesamt					411,533	0.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					1,981,791	1.0
Nettovermögen					$202,519,837	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	EUR	2,949	USD	3,269	06/10/2020	$ (5,251)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	USD	1,975	EUR	1,827	06/10/2020	53,737
Barclays Bank PLC	USD	1,505	EUR	1,378	06/10/2020	25,329

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC	GBP	586	USD	720	07/17/2020	$ (3,933)
BNP Paribas SA	EUR	950	USD	1,028	06/10/2020	(26,657)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	13,667	USD	14,911	06/10/2020	(262,250)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	692	EUR	635	06/10/2020	12,966
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	21	CHF	20	06/12/2020	199
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	71	GBP	57	06/12/2020	167
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	56,888	EUR	51,659	06/30/2020	487,636
Citibank, NA	EUR	1,826	USD	1,987	06/10/2020	(40,103)
Citibank, NA	EUR	22,652	USD	24,506	07/07/2020	(657,306)
Citibank, NA	GBP	9,020	USD	11,036	07/17/2020	(106,543)
Credit Suisse International	USD	881	EUR	811	06/10/2020	19,039
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	2,672	USD	2,935	06/10/2020	(31,870)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	4,046	EUR	3,707	06/10/2020	69,511
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,849	GBP	1,499	07/17/2020	2,188
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	15,536	USD	16,904	07/22/2020	(360,998)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	16,967	USD	18,416	07/30/2020	(441,049)
						$ (1,265,188)
					Wertsteigerung	$ 670,772
					Wertminderung	$ (1,935,960)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(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 31. Mai 2020.

(c) Tagesgeld.

Währungskürzel:

CHF – Swiss Franc
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
USD – United States Dollar

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (EUR)	Nettover-mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGELTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE							
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT							
FINANZINSTITUTE							
BANKWESEN							
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series G	0.75%	06/04/2025	EUR	200	€	200,085	1.1%
Bank of America Corp.	1.49%	05/19/2024	USD	200		183,050	1.0
Bank of America Corp.	2.46%	10/22/2025		200		187,303	1.0
Bank of America Corp., Series X(a)	6.25%	09/05/2024		20		18,824	0.1
Bank of America Corp., Series Z(a)	6.50%	10/23/2024		155		149,257	0.8
BNP Paribas SA(a)	6.75%	03/14/2022		210		194,539	1.0
BPCE SA	4.63%	07/11/2024		200		192,246	1.0
Canadian Imperial Bank of Commerce, Series DPNT	2.90%	09/14/2021	CAD	100		66,973	0.4
Citigroup, Inc.	1.68%	05/15/2024	USD	195		176,980	1.0
Cooperatieve Rabobank UA	5.25%	09/14/2027	GBP	160		210,697	1.1
Credit Agricole SA/London	4.13%	01/10/2027	USD	250		249,549	1.3
Credit Suisse AG/London	0.45%	05/19/2025	EUR	180		180,302	1.0
DNB Bank ASA(a)	6.50%	03/26/2022	USD	200		185,763	1.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	3.50%	04/01/2025		23		22,280	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	3.50%	11/16/2026		60		58,135	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	3.81%	04/23/2029		135		134,025	0.7
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(a)	5.30%	11/10/2026		12		11,008	0.1
ING Groep NV	2.13%	05/26/2031	EUR	100		101,120	0.5
ING Groep NV(a)	6.50%	04/16/2025	USD	200		182,412	1.0
Intesa Sanpaolo SpA	0.75%	12/04/2024	EUR	185		177,656	1.0
JPMorgan Chase & Co.	2.74%	10/15/2030	USD	200		187,357	1.0
Kookmin Bank	1.75%	05/04/2025		200		183,550	1.0
Lloyds Banking Group PLC	4.65%	03/24/2026		200		197,782	1.1
Mastercard, Inc.	3.30%	03/26/2027		70		71,661	0.4
Mastercard, Inc.	3.65%	06/01/2049		60		64,911	0.3
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	0.85%	07/19/2029	EUR	200		189,677	1.0
Morgan Stanley, Series G.	4.35%	09/08/2026	USD	195		198,442	1.1
National Australia Bank Ltd./New York	2.50%	07/12/2026		250		238,147	1.3
Royal Bank of Scotland Group PLC	2.36%	05/22/2024		200		181,787	1.0
Skandinaviska Enskilda Banken AB, Series G	1.38%	10/31/2028	EUR	195		193,771	1.0
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	USD	200		186,365	1.0
UBS Group AG(a)	7.00%	01/31/2024		200		186,163	1.0
Visa, Inc.	1.90%	04/15/2027		45		42,443	0.2
Westpac Banking Corp.	2.85%	05/13/2026		195		189,717	1.0
						5,193,977	27.9
VERSICHERUNGEN							
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.75%	08/15/2050		200		192,333	1.0
Assicurazioni Generali SpA	2.12%	10/01/2030	EUR	100		94,420	0.5
Chubb INA Holdings, Inc.	3.35%	05/03/2026	USD	90		90,611	0.5
CNP Assurances	2.00%	07/27/2050	EUR	100		95,863	0.5
						473,227	2.5
SONSTIGE FINANZWERTE							
Digital Dutch Finco BV	1.50%	03/15/2030		185		184,050	1.0
REITS							
American Tower Corp.	3.80%	08/15/2029	USD	190		192,229	1.0
Boston Properties LP	3.40%	06/21/2029		200		189,341	1.0
Healthpeak Properties, Inc.	3.50%	07/15/2029		195		178,251	1.0
Kilroy Realty LP	4.75%	12/15/2028		200		192,497	1.0
Prologis Euro Finance LLC	0.38%	02/06/2028	EUR	190		180,278	1.0
Prologis LP.	3.00%	04/15/2050	USD	65		58,810	0.3
Ventas Realty LP	4.40%	01/15/2029		185		168,543	0.9
Welltower, Inc.	4.95%	09/01/2048		170		156,850	0.9
						1,316,799	7.1
						7,168,053	38.5
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
Celulosa Arauco y Constitucion SA.	4.20%	01/29/2030		205		184,883	1.0
Ecolab, Inc.	3.95%	12/01/2047		115		125,492	0.7
Nutrien Ltd.	5.25%	01/15/2045		85		93,077	0.5
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	3.63%	04/03/2023		215		196,469	1.0
						599,921	3.2
INVESTITIONSGÜTER							
CNH Industrial NV	4.50%	08/15/2023		190		179,307	1.0
Ingersoll-Rand Global Holding Co., Ltd.	5.75%	06/15/2043		85		100,837	0.5
Signify NV	2.38%	05/11/2027	EUR	100		101,338	0.5
Xylem, Inc./NY	3.25%	11/01/2026	USD	195		189,334	1.0
						570,816	3.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (EUR)	Nettover-mögen %
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
Prosus NV	3.68%	01/21/2030	USD	205	€ 191,169	1.0%
Tencent Holdings Ltd.	3.93%	01/19/2038		200	202,602	1.1
					393,771	2.1
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
Orange SA(a)	1.75%	12/19/2026	EUR	200	196,116	1.1
Verizon Communications, Inc.	3.88%	02/08/2029	USD	215	225,026	1.2
Vodafone Group PLC	4.25%	09/17/2050		57	58,646	0.3
					479,788	2.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
American Honda Finance Corp., Series G	3.50%	02/15/2028		190	184,586	1.0
Aptiv PLC	4.25%	01/15/2026		205	197,720	1.1
General Motors Co.	5.00%	10/01/2028		190	176,381	0.9
General Motors Co.	5.40%	10/02/2023		100	94,932	0.5
Hyundai Capital America	5.88%	04/07/2025		95	93,830	0.5
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027		165	141,823	0.8
Volkswagen Group of America Finance LLC	3.13%	05/12/2023		200	184,862	1.0
					1,074,134	5.8
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Owens Corning	3.95%	08/15/2029		200	190,312	1.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
Lowe's Cos., Inc.	3.70%	04/15/2046		90	89,152	0.5
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Abbott Laboratories	4.75%	11/30/2036		45	53,481	0.3
AbbVie, Inc.	2.95%	11/21/2026		50	48,312	0.3
Amgen, Inc.	4.56%	06/15/2048		110	124,578	0.7
Baxter International, Inc.	2.60%	08/15/2026		200	194,204	1.0
Biogen, Inc.	5.20%	09/15/2045		90	106,065	0.6
Bristol-Myers Squibb Co.	3.25%	08/01/2042		115	116,823	0.6
CVS Health Corp.	4.30%	03/25/2028		190	195,671	1.1
Danaher Corp.	4.38%	09/15/2045		95	104,124	0.6
Fresenius Medical Care AG & Co. KGaA	1.50%	05/29/2030	EUR	100	100,597	0.5
Fresenius SE & Co. KGaA, Series 10Y	2.88%	02/15/2029		155	174,917	0.9
Gilead Sciences, Inc.	4.75%	03/01/2046	USD	100	120,477	0.7
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	4.20%	03/18/2043		50	56,864	0.3
Koninklijke Philips NV	1.38%	03/30/2025	EUR	100	104,529	0.6
Koninklijke Philips NV	5.00%	03/15/2042	USD	170	190,231	1.0
Pfizer, Inc.	4.20%	09/15/2048		90	104,110	0.6
Sanofi, Series 20FX	1.88%	03/21/2038	EUR	100	116,502	0.6
Stryker Corp.	4.10%	04/01/2043	USD	95	100,062	0.5
Thermo Fisher Scientific, Inc.	4.13%	03/25/2025		75	76,840	0.4
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	3.05%	01/15/2026		44	41,937	0.2
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	4.45%	08/15/2045		110	101,742	0.5
Zoetis, Inc.	4.45%	08/20/2048		105	118,653	0.6
					2,350,719	12.6
DIENSTLEISTUNGEN						
Amazon.com, Inc.	4.95%	12/05/2044		40	51,133	0.3
eBay, Inc.	3.45%	08/01/2024		210	204,265	1.1
					255,398	1.4
TECHNOLOGIE						
Analog Devices, Inc.	2.95%	04/01/2025		22	20,993	0.1
Analog Devices, Inc.	5.30%	12/15/2045		90	109,436	0.6
Fidelity National Information Services, Inc.	3.75%	05/21/2029		185	192,401	1.1
Intel Corp.	4.10%	05/11/2047		100	111,785	0.6
International Business Machines Corp.	4.70%	02/19/2046		100	115,964	0.6
NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA, Inc.	2.70%	05/01/2025		25	23,148	0.1
Oracle Corp.	4.00%	11/15/2047		105	110,740	0.6
					684,467	3.7
					6,688,478	35.9
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
Colbun SA	3.15%	03/06/2030		215	188,896	1.0
Commonwealth Edison Co.	3.00%	03/01/2050		50	46,994	0.3
Consolidated Edison Co. of New York, Inc., Series 20A.	3.35%	04/01/2030		97	97,238	0.5
E.ON SE.	0.88%	08/20/2031	EUR	171	171,141	0.9
EDP Finance BV	0.38%	09/16/2026		200	194,040	1.1
Enel Finance International NV	1.13%	10/17/2034		100	99,139	0.5
Enel Finance International NV	2.65%	09/10/2024	USD	205	191,134	1.0
Engie SA	0.50%	10/24/2030	EUR	100	97,433	0.5
Engie SA	1.75%	03/27/2028		100	107,845	0.6
Engie SA(a)	3.25%	11/28/2024		100	105,045	0.6
Entergy Texas, Inc.	3.55%	09/30/2049	USD	100	98,170	0.5

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (EUR)	Nettover-mögen %
	Florida Power & Light Co.	4.13%	02/01/2042	USD	90	€	100,939	0.5%
	NSTAR Electric Co.	3.25%	05/15/2029		145		148,804	0.8
	Orsted A/S	1.75%	12/09/3019	EUR	100		98,569	0.5
	Public Service Electric & Gas Co.	3.20%	08/01/2049	USD	33		32,764	0.2
	Scottish Hydro Electric Transmission PLC	2.25%	09/27/2035	GBP	200		234,350	1.3
							2,012,501	10.8
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE								
	American Water Capital Corp.	3.45%	05/01/2050	USD	11		10,892	0.1
	American Water Capital Corp.	4.30%	12/01/2042		100		107,579	0.6
	Anglian Water Services Financing PLC	1.63%	08/10/2025	GBP	160		179,972	1.0
	Anglian Water Services Financing PLC	4.50%	02/22/2026		145		175,686	0.9
	Severn Trent Utilities Finance PLC	2.00%	06/02/2040		100		113,741	0.6
							587,870	3.2
							2,600,371	14.0
							16,456,902	88.4
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT								
INDUSTRIE								
INVESTITIONSGÜTER								
	Clean Harbors, Inc.	4.88%	07/15/2027	USD	56		52,220	0.3
	GFL Environmental, Inc.	4.25%	06/01/2025		80		72,919	0.4
	GFL Environmental, Inc.	5.13%	12/15/2026		23		21,641	0.1
							146,780	0.8
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION								
	Telefonica Europe BV(a)	2.50%	02/05/2027	EUR	100		94,343	0.5
	Telefonica Europe BV(a)	2.88%	06/24/2027		100		95,216	0.5
							189,559	1.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER								
	Acadia Healthcare Co., Inc.	5.13%	07/01/2022	USD	45		40,380	0.2
	Catalent Pharma Solutions, Inc.	2.38%	03/01/2028	EUR	100		94,755	0.5
	DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	USD	100		89,986	0.5
	DaVita, Inc.	5.13%	07/15/2024		40		36,759	0.2
	HCA, Inc.	5.88%	02/01/2029		90		93,948	0.5
	LifePoint Health, Inc.	6.75%	04/15/2025		95		91,495	0.5
							447,323	2.4
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE								
	SPIE SA	2.63%	06/18/2026	EUR	100		96,019	0.5
DIENSTLEISTUNGEN								
	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH	2.00%	07/15/2025		100		96,592	0.6
TECHNOLOGIE								
	MSCI, Inc.	5.38%	05/15/2027	USD	40		38,772	0.2
							1,015,045	5.5
VERSORGUNGSBETRIEBE								
ELEKTRIZITÄT								
	EDP - Energias de Portugal SA	1.70%	07/20/2080	EUR	100		91,750	0.5
	Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	USD	45		39,866	0.2
							131,616	0.7
							1,146,661	6.2
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE								
QUASI-STAATSANLEIHEN								
CHILE								
	Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	3.65%	05/07/2030		200		192,649	1.0
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN								
CHILE								
	Chile Government International Bond	0.83%	07/02/2031	EUR	180		177,075	1.0
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN								
INDUSTRIE								
ENERGIE								
	ReNew Power Pvt Ltd.	6.45%	09/27/2022	USD	200		174,992	0.9
GEMEINDEVERWALTUNG – REGIONALANLEIHEN								
SPANIEN								
	Autonomous Community of Madrid Spain	0.83%	07/30/2027	EUR	74		76,111	0.4
							18,224,390	97.9

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)		Wert (EUR)	Nettover-mögen %
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
IndusInd Bank Ltd./Gift City	3.88%	04/15/2022	USD	210	€ 177,120	0.9%
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
Brookfield Renewable Partners ULC	4.25%	01/15/2029	CAD	270	197,022	1.1
					374,142	2.0
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN						
NEW YORK						
Metropolitan Transportation Authority, Series 2020C	5.18%	11/15/2049	USD	175	171,800	0.9
					545,942	2.9
Gesamtanlagen						
(Kosten €18,289,236)					€ 18,770,332	100.8%
Termineinlagen						
Citibank, New York(b)	0.01 %	–			94,378	0.5
HSBC France S.A., Paris(b)	(0.67)%	–			68,191	0.4
Termineinlagen insgesamt					162,569	0.9
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					(317,500)	(1.7)
Nettovermögen					€ 18,615,401	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Canadian 10 Yr Bond Futures	09/21/2020	2	€ 201,737	€ 201,050	€ (687)
U.S. Long Bond (CBT) Futures	09/21/2020	3	481,482	482,073	591
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	4	795,685	795,797	112
Short					
Euro-Bund Futures	06/08/2020	3	524,190	517,380	6,810
Euro-Schatz Futures	06/08/2020	4	449,760	448,220	1,540
Long Gilt Futures	09/28/2020	1	152,833	152,911	(78)
U.S. 10 Yr Ultra Futures	09/21/2020	3	423,080	425,191	(2,111)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2020	1	113,030	113,171	(141)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2020	1	197,310	196,415	895
					€ 6,931
				Wertsteigerung	€ 9,948
				Wertminderung	€ (3,017)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs-datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	484	USD	527	06/10/2020	€ (9,241)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	2,393	EUR	2,197	06/10/2020	41,340
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	2,160	EUR	1,966	06/12/2020	20,103
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	160	GBP	142	07/17/2020	(2,230)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	414	EUR	272	08/06/2020	1,193
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	18	GBP	16	06/12/2020	(396)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	19	USD	21	06/12/2020	(448)
Citibank, NA	USD	2,564	EUR	2,361	07/30/2020	54,478
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	3,153	EUR	2,914	07/07/2020	75,760
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP	849	EUR	961	07/17/2020	17,190
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	2,315	EUR	2,132	07/22/2020	48,510
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	2,784	EUR	2,482	06/04/2020	(25,327)
						€ 220,932
					Wertsteigerung	€ 258,574
					Wertminderung	€ (37,642)

\+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

CAD – Canadian Dollar
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
USD – United States Dollar

Glossar:

CBT – Chicago Board of Trade

Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.

	International Health Care Portfolio (USD)	International Technology Portfolio (USD)	Global Real Estate Securities Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	$ 1,003,854,266	$ 649,061,514	$ 41,453,810
Termineinlagen	103,623,752	21,358,941	352,901
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	-0-	-0-	-0-
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	27,240,449	11,455,127	145,737
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	-0-	-0-	7,905
Dividenden- und Zinsforderungen	1,518,013	485,213	90,380
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	1,057	18,015	196,288
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	-0-
Zinsforderungen aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe	1,555	28,513	7
Abgegrenzte Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	-0-	-0-
	1,136,239,092	682,407,323	42,247,028
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	13,881,223	3,243,881	48,752
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	6,530,484	8,617,015	75,705
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	6,696,070	2,315,460	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	-0-	-0-	178,073
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Zu zahlende Dividenden	25,409	-0-	17,315
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	-0-
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	-0-	-0-	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps	-0-	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	1,582,798	984,179	184,144
	28,715,984	15,160,535	503,989
NETTOVERMÖGEN	$ 1,107,523,108	$ 667,246,788	$ 41,743,039

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Sustainable Global Thematic Portfolio (USD)	India Growth Portfolio (USD)	Euro High Yield Portfolio (EUR)	US Small and Mid-Cap Portfolio (USD)	Emerging Markets Multi-Asset Portfolio (USD)	RMB Income Plus Portfolio (CNH)	Short Duration High Yield Portfolio (USD)	Select US Equity Portfolio (USD)
$ 766,218,478	$ 114,479,779	€ 342,789,612	$ 52,002,689	$ 1,110,699,300	CNH 1,182,890,094	$ 953,143,689	$ 3,351,094,866
61,969,247	2,890,918	1,451,314	1,897,261	31,677,588	7,647,704	20,093,133	79,795,237
-0-	-0-	1,359,336	1,048,918	9,543,969	14,364,579	3,583,900	64,561,497
11,702,451	1,292,319	219,359	481,214	1,335,578	28,066,878	30,436,847	19,036,696
760,422	15,130,726	1,227,307	-0-	76,224,450	112,070,281	21,784,045	-0-
890,237	127,867	4,118,138	54,632	9,198,312	14,842,767	12,300,975	3,672,848
4,059,443	7,613	789,008	37,562	16,208,512	5,332,111	2,107,046	2,972,638
-0-	-0-	74,775	-0-	26,510,077	-0-	13,660,856	-0-
-0-	-0-	520,378	-0-	7,739,899	4,703,471	4,917,672	-0-
-0-	-0-	188,350	-0-	-0-	949,494	363,525	-0-
-0-	-0-	106,965	-0-	95,452	15,186	849,584	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	14,656	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	446,932	-0-	8,076	-0-	-0-	-0-	-0-
845,600,278	134,376,154	352,844,542	55,530,352	1,289,247,793	1,370,882,565	1,063,241,272	3,521,133,782
-0-	-0-	1,444,332	756,803	11,609,034	45,969,226	21,924,799	29,779,712
898,082	846,039	415,542	1,058,449	3,807,571	-0-	1,443,487	21,233,991
1,126,549	357	755,467	293,765	75,175,588	2,012,985	11,510,901	742,073
4,764,212	-0-	250,501	-0-	10,124,718	10,091,316	2,147,411	399,298
-0-	-0-	132,842	-0-	5,067,939	7,843,447	17,998,737	-0-
60,152	1,069	83,745	-0-	3,551,264	1,743,387	1,125,413	15,824
-0-	-0-	37,510	-0-	2,176,062	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	462,311	-0-	866,399	-0-	2,798,208	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	7,166	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	106,964	-0-	391,328	285,832	886,958	-0-
1,168,899	276,236	341,927	61,687	2,012,799	2,330,751	1,295,328	3,364,619
8,017,894	1,123,701	4,031,141	2,170,704	114,789,868	70,276,944	61,131,242	55,535,517
$ 837,582,384	$ 133,252,453	€ 348,813,401	$ 53,359,648	$ 1,174,457,925	CNH 1,300,605,621	$1,002,110,030	$ 3,465,598,265

	Global Plus Fixed Income Portfolio (USD)	Select Absolute Alpha Portfolio (USD)	Emerging Market Local Currency Debt Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	$ 1,077,241,782	$ 719,935,903	$ 253,233,712
Termineinlagen	39,005,554	62,375,095	3,785,964
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	3,186,884	6,454,569	3,146,901
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	4,950,621	1,399,485	10,400
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	18,870,979	430,296	7,483,320
Dividenden- und Zinsforderungen	6,307,725	526,441	5,706,285
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	8,947,352	7,952,502	4,661,671
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	1,354,702	509,571	-0-
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	6,732	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	813,285	-0-	-0-
Zinsforderungen aus Swaps	222,914	-0-	270,965
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0-	-0-	-0-
Abgegrenzte Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	-0-	-0-
	1,160,908,530	799,583,862	278,299,218
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	74,985,651	12,318,935	185,927
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	1,196,289	10,624,192	-0-
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	3,731,359	56,838	1,722,579
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	14,214,830	310,394	4,843,539
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	6,011,358	270,062	168,843
Zu zahlende Dividenden	129,457	-0-	1,380,953
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	289,545	453,153	-0-
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	1,897,303	-0-	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	232,026	-0-	173,183
Zinsaufwand für Swaps	189,614	52,837	293,738
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	1,028,814	8,199,043	200,970
	103,906,246	32,285,454	8,969,732
NETTOVERMÖGEN	$ 1,057,002,284	$ 767,298,408	$ 269,329,486

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio (USD)	Emerging Market Corporate Debt Portfolio (USD)	US High Yield Portfolio (USD)	Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Global Dynamic Bond Portfolio (GBP)	Concentrated US Equity Portfolio (USD)	Concentrated Global Equity Portfolio (USD)
$ 16,939,826	$ 100,081,851	$ 112,538,464	$ 3,704,314,886	$ 1,241,799,623	£ 836,117,355	$ 882,877,280	$ 598,220,411
573,813	2,508,088	2,817,368	168,099,022	53,417,231	42,011,067	13,499,529	9,212,880
-0-	1,640,389	986,484	61,816,986	591,602	3,209,780	2,711,676	-0-
63,461	-0-	36,300	30,998,155	9,450	57,725	6,235,406	117,563,902
1,882,076	275,994	2,982,113	-0-	3,222,574	12,192,434	-0-	952,238
266,492	1,375,719	1,803,580	9,119,129	3,092,444	6,228,086	352,639	334,158
244,872	130,457	151,694	9,166,634	4,251	10,602,622	1,492,566	1,379,284
-0-	3,282	1,303,322	-0-	-0-	2,328,461	-0-	-0-
-0-	248,329	212,366	-0-	-0-	41,508	-0-	-0-
37,595	-0-	34,240	-0-	-0-	959,099	-0-	-0-
84,087	1,318	230,218	-0-	-0-	374,284	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	23,658	529	-0-	22,629	18,415
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	1,343	14,758	-0-	5,624	20,611	-0-	-0-
20,092,222	106,266,770	123,110,907	3,983,538,470	1,302,143,328	914,143,032	907,191,725	727,681,288
1,095,485	3,976,168	1,457,488	90,826,662	1,306,694	14,547,607	6,072,613	90,849,897
17,311	9	5,623	37,751,641	1,937	7,400	2,959,551	515,769
414,012	60,260	735,754	2,206,098	-0-	4,303,697	366,488	14,014,181
190,630	140,597	133,143	11,784,099	-0-	15,369,058	-0-	1,144,999
121,124	53,505	1,050,039	-0-	-0-	7,882,037	-0-	-0-
70,983	5,730	547,293	7,892,737	1,247	929,710	139,423	470,531
-0-	-0-	10,149	-0-	-0-	217,419	-0-	-0-
-0-	129,659	428,192	-0-	-0-	1,812,910	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
90,997	4,438	57,928	-0-	-0-	351,559	-0-	-0-
95,847	117,753	108,840	4,811,668	378,427	402,454	867,360	480,525
2,096,389	4,488,119	4,534,449	155,272,905	1,688,305	45,823,851	10,405,435	107,475,902
$ 17,995,833	$ 101,778,651	$ 118,576,458	$ 3,828,265,565	$ 1,300,455,023	£ 868,319,181	$ 896,786,290	$ 620,205,386

	Global Core Equity Portfolio (USD)	Global Income Portfolio (USD)	Alternative Risk Premia Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	$ 1,016,958,636	$ 88,654,357	$ 61,276,549
Termineinlagen	4,011,089	1,217,670	6,163,862
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	3,232,453	562,343	42,447,741
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	7,995,776	-0-	-0-
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	-0-	2,998,646	9,620,286
Dividenden- und Zinsforderungen	3,148,996	857,174	141,855
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	1,646,477	44,814	2,177,923
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	-0-	386,391	1,642,684
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	-0-	138,783	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	-0-	167,195	208,150
Zinsforderungen aus Swaps	-0-	41,526	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0-	-0-	2,968
Abgegrenzte Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	-0-	1,912
	1,036,993,427	95,068,899	123,683,930
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	8,235,536	968,516	1,131,281
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	1,247,482	-0-	72,363,456
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	1,116,094	104,174	5,016,466
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	48,009	464,165	1,076,050
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	-0-	2,783,257	1,704,352
Zu zahlende Dividenden	630,073	101,274	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	-0-	47,528	1,049,682
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	-0-	1,371,320	77,777
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps	-0-	30,377	57,610
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	771,031	165,930	185,534
	12,048,225	6,036,541	82,662,208
NETTOVERMÖGEN	$ 1,024,945,202	$ 89,032,358	$ 41,021,722

* Einschließlich Beitrag zu eingeschränkter Clearing-Reserve (gemäß Definition im Angebotsdokument) in Höhe von of CNY 1.414.802 (CNH 1.417.375). Siehe Anmerkung O.

** Die Anlageaktivität innerhalb des Euro High Yield Portfolio, die sich auf seine Anlage im Financial Credit Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des Emerging Markets Multi-Asset Portfolio, die sich auf seine Anlage im China A Shares Equity Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des RMB Income Plus Portfolio, die sich auf seine Anlage im China Bond Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des Global Plus Fixed Income Portfolio, die sich auf seine Anlage im China Bond Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio, die sich auf seine Anlage im China Bond Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des US High Yield Portfolio, die sich auf seine Anlage im Financial Credit Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des Global Dynamic Bond Portfolio, die sich auf seine Anlage im China Bond Portfolio bezieht, und die Anlageaktivität innerhalb des Global Income Portfolio, die sich auf seine Anlage im Financial Credit Portfolio bezieht, wurde aus Präsentationsgründen nicht in die kombinierten Finanzdaten aufgenommen.

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

European Equity Portfolio (EUR)	Eurozone Equity Portfolio (EUR)	American Growth Portfolio (USD)	All Market Income Portfolio (USD)	China A Shares Equity Portfolio (CNH)	Financial Credit Portfolio (USD)	Sustainable Global Thematic Credit Portfolio (EUR)	Kombiniert (USD)
€ 381,986,694	€ 1,190,247,100	$ 4,402,331,459	$ 1,036,484,950	CNH 958,853,265	$ 200,126,513	€ 18,770,332	$ 27,586,236,413**
10,805,939	27,181,860	444,900,335	202,432,997	184,708	411,533	162,569	1,497,779,501
-0-	18,970,610	9,635,546	164,360,155	-0-	18,649,746	-0-	555,416,441
14,755,594	3,879,559	60,664,599	10,221,628	717,374	321,423	-0-	371,077,467
17,855	90,593	-0-	39,436,656	13,264,160*	760,833	40,708	279,908,068
2,029,890	1,874,923	1,694,911	10,148,067	1,614,006	2,994,733	164,411	100,368,958**
349,985	708,244	6,375,483	10,191,335	534	670,772	258,574	99,739,342
-0-	-0-	-0-	11,676,578	-0-	-0-	-0-	66,611,755
-0-	-0-	-0-	6,506,425	-0-	-0-	-0-	24,441,267
234,095	1,186,808	-0-	4,464,140	-0-	-0-	9,948	9,356,636
-0-	-0-	-0-	1,392,712	-0-	-0-	-0-	3,978,786
801	9,922	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	124,873
-0-	-0-	-0-	-0-	15,976	-0-	7,907	61,415
-0-	-0-	-0-	-0-	294,144	-0-	7,807	618,722
410,180,853	1,244,149,619	4,925,602,333	1,497,315,643	974,944,167	223,935,553	19,422,256	30,595,719,644**
1,545,379	-0-	-0-	169,487,139	-0-	18,738,626	691,399	600,392,761
3,840,766	7,654,612	73,702,211	5,761,893	69	59,290	-0-	389,020,668
6,025,770	506,145	14,943,864	12,991,588	473,685	-0-	22,347	172,349,836
1,317,775	1,840,365	147,576	7,838,945	842	1,935,960	37,642	89,156,916
-0-	-0-	-0-	20,787,401	-0-	-0-	-0-	75,200,889
338,520	205,422	503,303	8,401,239	482	607,924	-0-	28,646,893**
-0-	-0-	-0-	1,625,802	-0-	-0-	3,017	25,845,093
-0-	-0-	-0-	5,978,762	-0-	-0-	-0-	16,595,034
-0-	-0-	-0-	5,673,484	-0-	-0-	-0-	6,191,893
-0-	-0-	-0-	466,157	-0-	-0-	-0-	3,435,409
381,023	1,263,723	4,133,810	2,016,045	1,159,563	73,916	52,450	39,006,344
13,449,233	11,470,267	93,430,764	241,028,455	1,634,641	21,415,716	806,855	1,445,841,736**
€ 396,731,620	€ 1,232,679,352	$ 4,832,171,569	$ 1,256,287,188	CNH 973,309,526	$ 202,519,837	€ 18,615,401	$ 29,149,877,908**

	International Health Care Portfolio (USD)	International Technology Portfolio (USD)	Global Real Estate Securities Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Dividenden, netto	$ 9,428,287	$ 2,991,410	$ 1,344,063
Zinsen	514,867	182,337	3,412
Swap-Erträge	-0-	-0-	-0-
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	95,431	250,797	113
	10,038,585	3,424,544	1,347,588
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	12,809,099	7,821,615	517,547
Aufwendungen für Swaps	-0-	-0-	-0-
Leistungsgebühr	-0-	-0-	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	380,167	258,808	23,565
Transferstelle	473,891	300,163	73,610
Steuern	389,168	266,519	22,377
Depotbankgebühren	82,275	56,045	30,267
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	256,612	208,396	41,454
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	127,476	90,222	34,121
Vertriebsgebühr	183,476	100,154	18,027
Druckkosten	24,197	88,142	491
Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Sonstige Aufwendungen	89,888	60,132	39,982
	14,816,249	9,250,196	801,441
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	-0-	-0-	(28,554)
Nettoaufwendungen	14,816,249	9,250,196	772,887
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	(4,777,664)	(5,825,652)	574,701
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	28,097,656	52,938,259	(397,578)
Kapitalertragsteuer	-0-	-0-	-0-
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	154,574,302	127,028,989	(8,964,750)
Aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften	1,331	17,964	53,851
Aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Aus verkauften Optionen	-0-	-0-	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	177,895,625	174,159,560	(8,733,776)
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	176,521,656	95,328,500	4,673,661
Ausschüttungen	(184,504)	-0-	(188,580)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	753,290,331	397,758,728	45,991,734
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	$ 1,107,523,108	$ 667,246,788	$ 41,743,039

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Sustainable Global Thematic Portfolio (USD)	India Growth Portfolio (USD)	Euro High Yield Portfolio (EUR)	US Small and Mid-Cap Portfolio (USD)	Emerging Markets Multi-Asset Portfolio (USD)	RMB Income Plus Portfolio (CNH)	Short Duration High Yield Portfolio (USD)	Select US Equity Portfolio (USD)
$ 5,577,862	$ 2,313,799	€ 489,446	$ 1,160,142	$ 36,121,994	CNH 3,788,161	$ 24,271	$ 52,419,572
448,578	18,225	19,527,999	13,618	35,660,859	51,618,714	44,569,533	1,481,785
-0-	-0-	238,098	-0-	4,161,566	2,493,367	4,170,476	4,225
36,098	-0-	-0-	523	201,939	-0-	-0-	591
6,062,538	2,332,024	20,255,543	1,174,283	76,146,358	57,900,242	48,764,280	53,906,173
10,683,021	3,030,489	2,371,828	780,576	20,170,187	12,242,416	9,443,962	35,767,782
-0-	-0-	98,374	-0-	3,218,144	3,589,889	2,038,536	93,161
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	335,613
326,065	91,102	95,890	32,789	609,064	475,968	488,361	898,559
439,501	209,430	81,378	47,089	612,942	460,095	504,660	903,810
325,261	83,736	88,669	31,049	567,678	468,883	488,949	1,113,001
111,288	115,777	128,034	18,770	761,026	607,891	166,338	287,923
256,877	143,601	178,394	127,442	295,143	831,977	246,670	437,747
123,007	52,439	86,170	37,795	195,030	380,126	140,717	217,274
162,619	75,816	236	263	70,815	-0-	41,563	-0-
23,788	3,637	9,303	2,424	37,866	21,607	17,215	87,379
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
74,434	24,735	51,635	27,230	367,854	154,185	108,295	355,259
12,525,861	3,830,762	3,189,911	1,105,427	26,905,749	19,233,037	13,685,266	40,497,508
-0-	-0-	(64,862)	(55,298)	-0-	(3)	-0-	(100,204)
12,525,861	3,830,762	3,125,049	1,050,129	26,905,749	19,233,034	13,685,266	40,397,304
(6,463,323)	(1,498,738)	17,130,494	124,154	49,240,609	38,667,208	35,079,014	13,508,869
75,155,541	(17,865,229)	(7,699,658)	(6,379,966)	(144,891,144)	653,650	(9,864,642)	136,071,287
2,242	3,938,807	-0-	-0-	(60,734)	-0-	-0-	-0-
42,198,080	(41,526,225)	(23,335,271)	(1,044,524)	28,007,387	(8,006,905)	(21,910,270)	160,550,828
-0-	9,189	1,700,047	-0-	(2,063,813)	4,450,560	733,626	-0-
(303,616)	34,040	258,377	44,711	1,530,374	6,520,610	(1,491,217)	4,118,951
-0-	-0-	(54,261)	-0-	14,933,613	(8,195,362)	(3,674,971)	(1,520,606)
-0-	-0-	-0-	-0-	(12,493)	-0-	359,807	-0-
110,588,924	(56,908,156)	(12,000,272)	(7,255,625)	(53,316,201)	34,089,761	(768,653)	312,729,329
1,562,032	(36,229,736)	(173,194,690)	(22,583,616)	(574,409,042)	(207,801,889)	55,544,274	(880,149,665)
(751,614)	(21,496)	(1,368,931)	-0-	(52,164,053)	(21,551,698)	(7,080,335)	(15,822)
726,183,042	226,411,841	535,377,294	83,198,889	1,854,347,221	1,495,869,447	954,414,744	4,033,034,423
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
$ 837,582,384	$ 133,252,453	€ 348,813,401	$ 53,359,648	$ 1,174,457,925	CNH 1,300,605,621	$ 1,002,110,030	$ 3,465,598,265

	Global Plus Fixed Income Portfolio (USD)	Select Absolute Alpha Portfolio (USD)	Emerging Market Local Currency Debt Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Dividenden, netto	$ 1,892,826	$ 6,859,632	$ -0-
Zinsen	19,304,069	5,357,683	19,275,086
Swap-Erträge	1,670,715	178,754	1,087,000
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	-0-	39	-0-
	22,867,610	12,396,108	20,362,086
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	5,071,512	11,557,710	519,280
Aufwendungen für Swaps	1,288,961	699,593	1,203,406
Leistungsgebühr	-0-	10,948,123	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	151,462	343,513	9,354
Transferstelle	260,551	286,983	23,764
Steuern	220,831	329,187	28,654
Depotbankgebühren	199,221	267,234	181,388
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	150,421	180,625	62,663
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	131,242	125,868	65,467
Vertriebsgebühr	1,597	-0-	-0-
Druckkosten	18,388	18,877	6,898
Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Sonstige Aufwendungen	93,720	243,176	42,604
	7,587,906	25,000,889	2,143,478
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	(92,446)	(15,564)	(287,312)
Nettoaufwendungen	7,495,460	24,985,325	1,856,166
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	15,372,150	(12,589,217)	18,505,920
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	39,481,788	16,165,689	(9,137,241)
Kapitalertragsteuer	-0-	-0-	(103,173)
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	(5,185,287)	21,698,287	(306,676)
Aus Finanzterminkontrakten	694,466	(690,966)	-0-
Aus Devisentermingeschäften	(8,292,536)	7,604,822	351,445
Aus Swaps	(4,714,228)	(2,755,413)	12,715
Aus verkauften Optionen	146,315	-0-	235,297
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	37,502,668	29,433,202	9,558,287
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	4,193,786	(277,835,226)	15,677,055
Ausschüttungen	(1,098,479)	-0-	(15,864,634)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	1,016,404,309	1,015,700,432	259,958,778
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	$ 1,057,002,284	$ 767,298,408	$ 269,329,486

(a) Die Finanzinformationen für das Global Equity Income Portfolio beziehen sich auf den Zeitraum vom 1. Juni 2019 bis zum 9. Dezember 2019. Siehe Bericht des Verwaltungsrats.

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio (USD)	Emerging Market Corporate Debt Portfolio (USD)	US High Yield Portfolio (USD)	Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Global Dynamic Bond Portfolio (GBP)	Global Equity Income Portfolio (USD)(a)	Concentrated US Equity Portfolio (USD)
$ 53,563	$ 4,001	$ 203,016	$ 64,792,796	$ 35,872,896	£ 605,004	$ 97,294	$ 5,787,899
1,101,716	6,405,174	5,063,151	1,129,610	355,995	17,796,828	1,168	320,870
87,111	28,495	551,119	-0-	-0-	2,743,378	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	499,991	35,999	-0-	-0-	103,107
1,242,390	6,437,670	5,817,286	66,422,397	36,264,890	21,145,210	98,462	6,211,876
253,826	130,367	81,348	40,958,127	341,734	833,799	3,258	7,286,293
94,134	49,476	178,204	-0-	-0-	2,335,281	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
9,820	15,575	2,777	1,411,243	62,845	54,715	323	296,623
15,438	18,416	8,821	1,629,386	119,259	75,956	709	264,955
9,353	14,303	11,459	1,446,888	153,667	86,373	323	295,318
28,677	69,849	72,477	375,388	529,083	214,040	6,929	91,205
70,263	58,781	22,351	355,138	182,417	153,521	13,944	124,647
30,230	42,402	39,513	217,274	190,661	109,440	27,691	134,646
34,714	-0-	-0-	54,677	-0-	-0-	-0-	-0-
2,394	3,841	3,280	63,710	30,418	14,966	558	16,338
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
29,477	30,859	35,334	282,976	222,606	42,022	17,399	68,221
578,326	433,869	455,564	46,794,807	1,832,690	3,920,113	71,134	8,578,246
(110,409)	(55,352)	(165,812)	-0-	(199,965)	(142,891)	(63,200)	(311)
467,917	378,517	289,752	46,794,807	1,632,725	3,777,222	7,934	8,577,935
774,473	6,059,153	5,527,534	19,627,590	34,632,165	17,367,988	90,528	(2,366,059)
(584,032)	2,019,347	(2,402,361)	(183,402,705)	(123,281,139)	(7,829,552)	237,612	100,052,203
(9)	-0-	-0-	-0-	1,439,261	-0-	-0-	-0-
(90,388)	(6,985,397)	(3,328,642)	84,955,118	71,049,870	(2,232,516)	137,636	13,053,441
8,055	45,992	19,589	1,864,423	-0-	1,635,653	-0-	-0-
411,596	(59,247)	(48,776)	(5,108,895)	5,473	5,572,196	(10,984)	2,000,056
(111,576)	(26,680)	196,398	-0-	-0-	(4,843,620)	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
408,119	1,053,168	(36,258)	(82,064,469)	(16,154,370)	9,670,149	454,792	112,739,641
(3,800,723)	(6,986,058)	67,819,245	1,396,284,956	(234,730,243)	132,002,961	(5,284,812)	(1,553,483)
(860,730)	(48,578)	(5,083,536)	(68,651,980)	(27,750)	(3,495,820)	(3,764)	(711,946)
22,249,167	107,760,119	55,877,007	2,582,697,058	1,551,367,386	730,141,891	4,833,784	786,312,078
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
$ 17,995,833	$ 101,778,651	$ 118,576,458	$ 3,828,265,565	$ 1,300,455,023	£ 868,319,181	$ -0-	$ 896,786,290

	Concentrated Global Equity Portfolio (USD)	Global Core Equity Portfolio (USD)	Global Income Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Dividenden, netto	$ 2,644,731	$ 26,876,209	$ 428,717
Zinsen	117,894	62,901	5,320,676
Swap-Erträge	-0-	-0-	1,127,811
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	94,836	77,361	-0-
	2,857,461	27,016,471	6,877,204
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	3,151,886	8,033,224	610,256
Aufwendungen für Swaps	-0-	-0-	333,037
Leistungsgebühr	-0-	-0-	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	106,162	155,399	39,809
Transferstelle	94,565	190,492	56,385
Steuern	113,617	237,186	36,327
Depotbankgebühren	50,960	233,803	87,014
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	124,065	247,666	72,875
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	77,637	199,906	45,046
Vertriebsgebühr	-0-	-0-	-0-
Druckkosten	5,094	32,485	2,832
Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Sonstige Aufwendungen	43,190	115,207	42,380
	3,767,176	9,445,368	1,325,961
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	(9)	(9,365)	(86,312)
Nettoaufwendungen	3,767,167	9,436,003	1,239,649
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	(909,706)	17,580,468	5,637,555
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	6,216,819	103,380,904	4,368,952
Kapitalertragsteuer	-0-	-0-	-0-
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	35,248,920	(11,802,397)	(3,120,506)
Aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	(268,476)
Aus Devisentermingeschäften	48,748	2,293,495	(835,748)
Aus Swaps	-0-	-0-	(2,367,680)
Aus verkauften Optionen	-0-	-0-	(23,370)
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	40,604,781	111,452,470	3,390,727
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	344,037,919	(822,362,451)	(42,526,721)
Ausschüttungen	(469,323)	(2,639,836)	(1,248,820)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	236,032,009	1,738,495,019	129,417,172
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	$ 620,205,386	$ 1,024,945,202	$ 89,032,358

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Alternative Risk Premia Portfolio (USD)	European Equity Portfolio (EUR)	Eurozone Equity Portfolio (EUR)	American Growth Portfolio (USD)	All Market Income Portfolio (USD)	China A Shares Equity Portfolio (CNH)	Financial Credit Portfolio (USD)	Sustainable Global Thematic Credit Portfolio (EUR)
$ 879,179	€ 12,023,492	€ 27,058,941	$ 13,725,081	$ 10,790,602	CNH 7,861,251	$ -0-	€ -0-
514,613	-0-	-0-	3,397,069	18,403,670	47,262	7,733,946	465,505
462,249	-0-	-0-	-0-	7,201,875	48	-0-	6
14,111	187,885	328,211	1,028	-0-	-0-	-0-	-0-
1,870,152	12,211,377	27,387,152	17,123,178	36,396,147	7,908,561	7,733,946	465,511
166,310	4,291,090	12,428,502	33,199,270	11,361,356	40,159	155,564	72,930
1,230,702	-0-	-0-	-0-	3,153,564	3,691	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
14,085	337,947	612,038	1,795,854	704,190	59,485	14,106	1,829
14,099	217,799	345,752	982,532	495,971	47,405	18,489	1,844
13,222	172,276	346,238	1,109,396	391,837	73,331	32,226	1,823
167,246	135,931	184,351	157,464	435,519	1,077,751	23,035	30,072
55,895	215,213	233,830	443,476	297,398	246,547	54,591	19,647
44,264	98,016	175,048	217,274	130,426	278,456	50,799	24,900
-0-	12,507	10,487	234,178	279,514	-0-	-0-	-0-
4,625	13,963	23,175	73,963	15,162	19,912	3,863	437
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	43,624	3,009	2,006
52,099	154,241	359,021	231,554	80,558	623,521	31,977	19,284
1,762,547	5,648,983	14,718,442	38,444,961	17,345,495	2,513,882	387,659	174,772
(169,350)	-0-	-0-	-0-	(4,897)	(1,139,634)	(132,721)	(72,109)
1,593,197	5,648,983	14,718,442	38,444,961	17,340,598	1,374,248	254,938	102,663
276,955	6,562,394	12,668,710	(21,321,783)	19,055,549	6,534,313	7,479,008	362,848
(7,767,017)	(77,740,911)	(133,940,412)	195,533,999	(183,005,066)	152,484,205	921,066	(33,822)
-0-	-0-	-0-	-0-	4	-0-	-0-	-0-
(567,959)	14,483,154	(89,894,843)	803,215,163	(50,945,737)	114,392,839	4,982,589	459,621
(896,242)	234,095	1,991,934	-0-	2,647,868	-0-	-0-	(20,396)
176,504	(981,134)	(1,303,223)	7,138,142	1,734,138	(308)	(1,846,644)	238,871
148,200	-0-	-0-	-0-	(10,233,839)	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	(175,779)	-0-	-0-	-0-
(8,629,559)	(57,442,402)	(210,477,834)	984,565,521	(220,922,862)	273,411,049	11,536,019	1,007,122
(65,703,700)	(116,577,482)	239,780,600	822,319,743	1,247,317,491	508,258,742	77,242,047	45,846
-0-	(3,193,249)	(205,915)	(4,495,629)	(60,740,791)	(958)	(6,595,081)	-0-
115,354,981	573,944,753	1,203,582,501	3,029,781,934	290,633,350	191,640,693	120,336,852	17,562,433
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
$ 41,021,722	€ 396,731,620	€ 1,232,679,352	$ 4,832,171,569	$ 1,256,287,188	CNH 973,309,526	$ 202,519,837	€ 18,615,401

	Kombiniert (USD)
ANLAGEERTRÄGE	
Dividenden, netto	$ 332,249,368*
Zinsen	249,929,127
Swap-Erträge	25,518,423
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	2,016,537
	609,713,455*
AUFWENDUNGEN	
Verwaltungsgebühr	250,183,318
Aufwendungen für Swaps	18,275,031
Leistungsgebühr	11,283,736
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	9,642,876
Transferstelle	9,029,363
Steuern	8,704,030
Depotbankgebühren	6,306,524
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	5,882,625
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	3,806,688
Vertriebsgebühr	1,283,105
Druckkosten	695,367
Gründungskosten	25,219
Sonstige Aufwendungen	3,986,330
	329,104,212
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	(2,937,531)
Nettoaufwendungen	326,166,681
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	283,546,774*
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)	
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	(106,903,042)
Kapitalertragsteuer	5,205,966
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)	
Aus Anlagen	1,287,520,933*
Aus Finanzterminkontrakten	(11,324,480)
Aus Devisentermingeschäften	13,344,420
Aus Swaps	(18,941,867)
Aus verkauften Optionen	816,059
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	1,453,264,763*
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN	
Steigerung	1,468,327,375*
Ausschüttungen	(251,532,823)*
NETTOVERMÖGEN	
Zu Beginn des Geschäftsjahres	26,530,867,445
Anpassung aus Währungsumrechnung	(51,048,852)*
Am Ende des Geschäftsjahres	$ 29,149,877,908*

* Die Anlageaktivität innerhalb des Euro High Yield Portfolio, die sich auf seine Anlage im Financial Credit Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des Emerging Markets Multi-Asset Portfolio, die sich auf seine Anlage im China A Shares Equity Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des RMB Income Plus Portfolio, die sich auf seine Anlage im China Bond Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des Global Plus Fixed Income Portfolio, die sich auf seine Anlage im China Bond Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio, die sich auf seine Anlage im China Bond Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des US High Yield Portfolio, die sich auf seine Anlage im Financial Credit Portfolio bezieht, die Anlageaktivität innerhalb des Global Dynamic Bond Portfolio, die sich auf seine Anlage im China Bond Portfolio bezieht, und die Anlageaktivität innerhalb des Global Income Portfolio, die sich auf seine Anlage im Financial Credit Portfolio bezieht, wurde aus Präsentationsgründen nicht in die kombinierten Finanzdaten aufgenommen.

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	International Health Care Portfolio	International Technology Portfolio	Global Real Estate Securities Portfolio
KLASSE			
A	1,816,989	678,448	688,442
A EUR H	6,812	-0-	-0-
A PLN H	-0-	96,745	-0-
AD	19,858	-0-	147,271
AD AUD H	-0-	-0-	44,817
AD NZD H	-0-	-0-	39,448
AD SGD H	-0-	-0-	4,607
AX	8,909	-0-	-0-
B	22,843	25,183	77,311
BD	-0-	-0-	2,731
BD AUD H	-0-	-0-	1,453
BX	2,220	-0-	-0-
C	62,640	34,708	37,677
E	-0-	227,835	-0-
ED	1,125,810	-0-	-0-
I	351,801	580,393	691,912
I GBP	56,963	-0-	-0-
ID	-0-	-0-	62,277
S1	109	92	176,395
S14 GBP	949,355	-0-	-0-

	Sustainable Global Thematic Portfolio	India Growth Portfolio	Euro High Yield Portfolio
KLASSE			
A	1,648,534	714,013	84,374
A AUD H	270,066	-0-	-0-
A EUR H	9,874	-0-	-0-
A PLN H	-0-	380	-0-
A SGD H	25,933	15,646	-0-
A2	-0-	-0-	136,498
A2 CHF H	-0-	-0-	600
A2 PLN H	-0-	-0-	380
A2 USD H	-0-	-0-	5,519
AA	-0-	-0-	322,037
AA AUD H	-0-	-0-	28,752
AA HKD H	-0-	-0-	1,070
AA RMB H	-0-	-0-	968
AA SGD H	-0-	-0-	1,228
AA USD H	-0-	-0-	368,324
AD AUD H	-0-	95,433	-0-
AN	724	-0-	-0-
AR	-0-	-0-	1,051
AT	-0-	-0-	446,345
AT AUD H	-0-	-0-	987
AT SGD H	-0-	-0-	1,128
AT USD H	-0-	-0-	362,900
AX	5,389,330	319,311	-0-
AXX	20,837	-0-	-0-
B	60,676	4,509	-0-
B CAD H	631	-0-	-0-
B2	-0-	-0-	1,015
BX	226,002	54,903	-0-
BXX	27,951	-0-	-0-
C	69,451	2,979	2,680
C2	-0-	-0-	3,817
CT USD H	-0-	-0-	54,760
CX	16,669	-0-	-0-
I	4,088,479	36,984	553,689
I EUR H	5,460	-0-	-0-
I2	-0-	-0-	3,134,519
I2 CHF H	-0-	-0-	600
I2 GBP H	-0-	-0-	467
I2 USD H	-0-	-0-	26,280
IN	647	-0-	-0-
IT USD H	-0-	-0-	45,403
IX	61,048	-0-	-0-
NT USD H	-0-	-0-	7,639
S	667	771	4,703,716
S GBP	177,611	-0-	-0-
S1	2,959,988	768	3,717,254
S1 USD H	-0-	-0-	667
S1X	164,810	-0-	-0-
SD	130,031	-0-	-0-
SX	1,055	-0-	-0-

	US Small and Mid-Cap Portfolio	Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	RMB Income Plus Portfolio
KLASSE			
A	903,301	8,734,748	-0-
A AUD H	81	339,701	-0-
A CAD H	-0-	4,377	-0-
A CHF H	-0-	3,887	-0-
A EUR H	48,865	857,715	-0-
A GBP H	-0-	95,623	-0-
A SGD H	1,000	246,069	-0-
A2	-0-	-0-	2,745,016
AD	-0-	39,377,435	-0-
AD AUD H	-0-	11,248,816	-0-
AD CAD H	-0-	1,610,960	-0-
AD EUR H	-0-	1,362,573	-0-
AD GBP H	-0-	1,693,769	-0-
AD RMB H	-0-	56,072	-0-
AD SGD H	-0-	5,451,216	-0-
AD ZAR H	-0-	2,253,650	-0-
AR	-0-	215,814	-0-
AR EUR	-0-	-0-	768
AR EUR H	-0-	216,982	-0-
AT	-0-	-0-	4,593,435
B	932	6,323	-0-
BD	-0-	154,583	-0-
C	96,713	318,308	-0-
C EUR H	763	-0-	-0-
C2	-0-	-0-	12,114
CT	-0-	-0-	168,575
ED	-0-	364,221	-0-
ED AUD H	-0-	34,704	-0-
ED ZAR H	-0-	55,249	-0-
I	873,300	1,964,157	-0-
I CHF H	-0-	4,387	-0-
I EUR H	8,894	130,112	-0-
I GBP	-0-	533	-0-
I GBP H	-0-	79,075	-0-
I2	-0-	-0-	833,376
ID	-0-	2,753,669	-0-
ID GBP H	-0-	454,482	-0-
IT	-0-	-0-	107,664
N	-0-	133,422	-0-
S	632	686,991	674
S EUR H	538	-0-	-0-
S GBP H	-0-	450	-0-
S1	667	14,759,180	2,180,396
S1 EUR H	538	-0-	-0-
S1 JPY	-0-	2,158	-0-
S1 JPY H	-0-	1,516	-0-
S1D	-0-	117	-0-
SD	-0-	315,184	-0-
SQD GBP H	-0-	6,024,480	-0-
W2	-0-	-0-	650

	Short Duration High Yield Portfolio	Select US Equity Portfolio	Global Plus Fixed Income Portfolio
KLASSE			
1	-0-	-0-	3,424,263
1 EUR H	-0-	-0-	12,071
1 GBP H	-0-	-0-	25,393
1D	-0-	-0-	1,303,475
1D EUR H	-0-	-0-	88,239
1D GBP H	-0-	-0-	188,860
2	-0-	-0-	3,389,180
2 EUR H	-0-	-0-	244,865
2 GBP H	-0-	-0-	515
A	-0-	10,524,773	-0-
A AUD H	-0-	3,694	-0-
A CHF H	-0-	53,661	-0-
A CZK H	-0-	2,344	-0-
A EUR H	-0-	1,997,993	-0-
A GBP H	-0-	269,183	-0-
A PLN H	-0-	380	-0-
A SGD H	-0-	92,845	-0-
A2	15,967,852	-0-	486,077
A2 CHF H	4,339	-0-	-0-
A2 EUR H	686,525	-0-	13,581
A2 GBP H	58,936	-0-	-0-
A2 SGD H	-0-	-0-	94,450
AA	197,019	-0-	-0-
AA AUD H	7,884	-0-	-0-
AA SGD H	1,218	-0-	-0-
AR	-0-	26,249	-0-
AR EUR H	1,584	1,767	621
AT	4,990,707	-0-	93,697
AT AUD H	95,195	-0-	1,788,607
AT CAD H	168,215	-0-	6,046
AT EUR H	606,328	-0-	12,433
AT GBP H	92,385	-0-	3,027
AT SGD H	91,155	-0-	80,372
B2	34,078	-0-	-0-
BT	54,187	-0-	689
BT CAD H	4,262	-0-	11,512
C	-0-	2,296,311	-0-
C2	4,156,242	-0-	906,470
C2 EUR H	-0-	-0-	507
CT	2,292,221	-0-	18,393
F	-0-	4,105,332	-0-
F EUR H	-0-	95,430	-0-
I	-0-	7,993,696	-0-
I CHF H	-0-	111,575	-0-
I EUR H	-0-	879,110	-0-
I GBP H	-0-	29,729	-0-
I SGD H	-0-	4,244	-0-
I2	13,981,668	-0-	7,073,846
I2 CHF H	182,705	-0-	-0-
I2 EUR H	3,149,411	-0-	507
I2 GBP H	87,082	-0-	433
IK EUR H	-0-	-0-	1,363,552
IT	2,928,246	-0-	-0-
IT EUR H	33,941	-0-	-0-
IT GBP H	520	-0-	-0-
IT SGD H	1,122	-0-	-0-
N	-0-	1,444,888	-0-
N2	1,099,728	-0-	-0-
NT	837,849	-0-	-0-

	Short Duration High Yield Portfolio	Select US Equity Portfolio	Global Plus Fixed Income Portfolio
KLASSE			
S	629,143	2,580,316	2,195,518
S CAD H	-0-	-0-	657,340
S EUR H	-0-	1,000	-0-
S GBP H	-0-	667	11,227
S1	382,943	30,904,535	25,267,607
S1 EUR H	-0-	253,710	400
S1 GBP H	-0-	667	-0-
S1 JPY	-0-	1,526,013	-0-
S1 JPY H	-0-	965,690	-0-
S1 SGD H	-0-	125	-0-
S1QD EUR H	29,147	-0-	-0-
SA	-0-	-0-	194,818
W	-0-	26,660,591	-0-
W CHF H	-0-	1,156,402	-0-
W EUR H	-0-	5,537,694	-0-
W GBP H	-0-	7,809	-0-
W SGD H	-0-	2,333	-0-
W2 CHF H	667	-0-	-0-

	Select Absolute Alpha Portfolio	Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio
KLASSE			
A	8,774,638	-0-	-0-
A AUD H	733	-0-	-0-
A CHF H	24,168	-0-	-0-
A EUR H	3,051,118	-0-	-0-
A GBP H	169,235	-0-	-0-
A PLN H	380	-0-	-0-
A SGD H	133,240	-0-	-0-
A2	-0-	46,408	22,794
A2 AUD H	-0-	-0-	627
A2 CZK H	-0-	275	-0-
A2 EUR H	-0-	650	6,528
A2 PLN H	-0-	380	-0-
A2 SGD H	-0-	-0-	840
AA	-0-	17,110	407
AA AUD H	-0-	-0-	219
AA CAD H	-0-	-0-	213
AA EUR H	-0-	-0-	138
AA GBP H	-0-	-0-	125
AA SGD H	-0-	-0-	233
AR EUR H	-0-	-0-	730
AT	-0-	1,666	647,252
AT AUD H	-0-	-0-	342,422
AT CAD H	-0-	-0-	52,226
AT EUR H	-0-	-0-	25,158
AT GBP H	-0-	-0-	198,713
AT SGD H	-0-	1,240	12,538
B2	-0-	-0-	667
BT	-0-	-0-	166,307
BT AUD H	-0-	-0-	28,556
BT CAD H	-0-	-0-	17,043
BT EUR H	-0-	-0-	42,388
BT GBP H	-0-	-0-	2,642
C	1,624,748	-0-	-0-
C2	-0-	-0-	667
C2 EUR H	-0-	-0-	513
F	112,643	-0-	-0-
F EUR H	21,866	-0-	-0-
I	5,371,820	-0-	-0-
I CHF H	134,685	-0-	-0-
I EUR H	5,055,595	-0-	-0-
I GBP H	95,489	-0-	-0-
I2	-0-	76,429	667
I2 EUR H	-0-	500	564
I2 SGD H	-0-	-0-	840
IT	-0-	-0-	1,021
IT AUD H	-0-	-0-	1,006
IT EUR H	-0-	-0-	711
IT SGD H	-0-	-0-	1,130
N	651,324	-0-	-0-
S	660	750	679
S EUR H	500	-0-	-0-
S GBP H	427	-0-	-0-
S1	449	4,585,490	667
S1 EUR H	5,180,989	-0-	-0-
S1 GBP H	427	-0-	-0-
S1 JPY H	614,982	-0-	-0-
S13 EUR H	314,962	-0-	-0-
SA	-0-	22,967	-0-
W	667	-0-	-0-
W CHF H	667	-0-	-0-
ZT	-0-	15,593,573	-0-

	Emerging Market Corporate Debt Portfolio	US High Yield Portfolio	Low Volatility Equity Portfolio
KLASSE			
A	-0-	-0-	26,339,996
A AUD H	-0-	-0-	614,161
A EUR	-0-	-0-	14,624
A EUR H	-0-	-0-	950,745
A NZD H	-0-	-0-	159,863
A PLN H	-0-	-0-	380
A SGD H	-0-	-0-	1,087,010
A2	43,245	37,918	-0-
A2 AUD H	600	-0-	-0-
A2 CAD H	706	-0-	-0-
A2 EUR H	3,257	2,270	-0-
A2 GBP H	400	-0-	-0-
A2 SGD H	800	-0-	-0-
AA	994	-0-	-0-
AA AUD H	1,048	-0-	-0-
AA SGD H	1,288	-0-	-0-
AD	-0-	-0-	66,339,132
AD AUD H	-0-	-0-	14,043,655
AD CAD H	-0-	-0-	3,519,446
AD EUR H	-0-	-0-	1,244,214
AD GBP H	-0-	-0-	3,667,546
AD NZD H	-0-	-0-	2,053,346
AD RMB H	-0-	-0-	1,707,622
AD SGD H	-0-	-0-	8,859,618
AD ZAR H	-0-	-0-	25,186
AR	-0-	-0-	22,090
AR EUR	1,063	-0-	-0-
AR EUR H	-0-	-0-	1,786
AT	9,660	-0-	-0-
AT AUD H	921	-0-	-0-
AT CAD H	939	-0-	-0-
AT EUR H	678	-0-	-0-
AT GBP H	4,729	-0-	-0-
AT NZD H	1,251	-0-	-0-
AT RMB H	6,623	-0-	-0-
AT SGD H	1,114	-0-	-0-
C	-0-	-0-	3,576,367
C2	667	25,320	-0-
CT	886	-0-	-0-
ED	-0-	-0-	615,649
ED AUD H	-0-	-0-	141,979
ED ZAR H	-0-	-0-	315,674
I	-0-	-0-	11,995,669
I EUR	-0-	-0-	7,031
I EUR H	-0-	-0-	779,512
I GBP	-0-	-0-	1,778
I GBP H	-0-	-0-	220,970
I SGD H	-0-	-0-	39,298
I2	84,436	295,215	-0-
I2 EUR H	434	500	-0-
IT	33,756	-0-	-0-
N	-0-	-0-	4,130,689
N2	143,895	40,158	-0-
NT	30,790	142,382	-0-
S	4,162,046	-0-	1,635,509
S EUR H	-0-	-0-	30,080
S1	667	463	18,749,609
S1 EUR	-0-	-0-	90
S1 EUR H	-0-	53,723	80,331
S1D	-0-	-0-	297,058
SD	-0-	-0-	664,851
ZT	-0-	7,498,718	-0-

KLASSE	Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	Global Dynamic Bond Portfolio	Concentrated US Equity Portfolio
A	93,250	-0-	3,669,028
A AUD H	-0-	-0-	123,102
A EUR	-0-	-0-	262,281
A EUR H	-0-	-0-	304,966
A SGD H	-0-	-0-	358,043
A2 CHF H	-0-	667	-0-
A2 EUR H	-0-	813,277	-0-
A2 SGD H	-0-	933	-0-
A2 USD H	-0-	667	-0-
AD	20,554	-0-	-0-
AD AUD H	18,503	-0-	-0-
AD CAD H	934	-0-	-0-
AD EUR H	551	-0-	-0-
AD GBP H	493	-0-	-0-
AD NZD H	1,015	-0-	-0-
AD SGD H	933	-0-	-0-
AR EUR	-0-	-0-	100,613
AR EUR H	-0-	667	-0-
C	-0-	-0-	776,612
F	195,705	-0-	-0-
F EUR H	85	-0-	-0-
I	696,300	-0-	9,990,370
I AUD H	-0-	-0-	1,894
I CHF H	-0-	-0-	66,765
I EUR H	-0-	-0-	562,691
I GBP	-0-	-0-	533
I GBP H	500	-0-	101,184
I SGD H	999	-0-	4,397
I2	-0-	154,215	-0-
I2 CHF H	-0-	240,917	-0-
I2 EUR H	-0-	963,015	-0-
I2 USD H	-0-	667	-0-
N	-0-	-0-	149,893
S	7,725,413	26,201,546	4,068,182
S EUR	175,918	-0-	-0-
S EUR H	-0-	2,051,964	647,668
S GBP	37,648,258	-0-	-0-
S USD H	-0-	667	-0-
S1	543	2,288,138	6,226,234
S1 EUR H	-0-	467	405,723
S1 GBP H	-0-	-0-	282,616
S1 SGD H	-0-	400,250	-0-
S1 USD H	-0-	667	-0-
S1QD	-0-	636,992	-0-
SD	-0-	-0-	147,127
SQD	-0-	6,330,872	-0-

	Concentrated Global Equity Portfolio	Global Core Equity Portfolio
KLASSE		
A	941,689	989,945
A AUD H	-0-	707
A EUR H	65,846	237,525
A SGD H	5,931	800
AR EUR	498,861	908,496
C	11,693	7,842
I	4,207,681	5,245,417
I AUD H	-0-	2,025,193
I CAD H	8,163	-0-
I CHF H	10,514	593
I EUR	3,459,474	82,429
I EUR H	66,432	140,853
I GBP	533	-0-
I GBP H	36,832	129,703
I SGD H	-0-	800
IX EUR	-0-	188,653
N	8,278	25,408
RX EUR	-0-	52,028
S	494,934	8,343,320
S EUR H	500	467
S GBP	175,208	-0-
S GBP H	-0-	502,499
S NOK HP	-0-	91
S1	12,955,178	23,431,270
S1 EUR H	500	467
S1 GBP H	-0-	-0-
S1 NOK HP	-0-	135,087
SD	-0-	439,505

	Global Income Portfolio
KLASSE	
A	-0-
A EUR H	-0-
A2	622,782
A2 AUD H	867
A2 CAD H	867
A2 CHF H	667
A2 EUR H	613
A2 GBP H	533
A2 PLN H	16,443
A2 SGD H	36,648
AA	201,573
AA AUD H	975
AA CAD H	969
AA EUR H	638
AA GBP H	-0-
AA NZD H	-0-
AA SGD H	1,042
AD	-0-
AD EUR H	-0-
AT	850,241
AT AUD H	94,055
AT CAD H	14,476
AT EUR H	549
AT GBP H	565
AT SGD H	199,601
I	-0-
I2	40,051
I2 AUD H	867
I2 CAD H	867
I2 CHF H	667
I2 EUR H	613
I2 GBP H	20,671
I2 SGD H	933
IT	205,414
IT AUD H	952
IT CAD H	947
IT EUR H	625
IT SGD H	60,864
S	491,604
S EUR H	90
S GBP H	80
S1	100
S1 EUR H	90
S1 GBP H	80
ZT	-0-

	Alternative Risk Premia Portfolio
KLASSE	
A	-0-
A2	-0-
A2 EUR H	-0-
AT	-0-
F	100
F EUR H	90
F GBP H	80
I	151,805
I EUR H	26,107
I GBP H	533
I2	-0-
I2 EUR H	-0-
IT	-0-
S	25,151
S1	100
S1 EUR H	11,397
S1 GBP H	80
S1D	-0-
S1D EUR H	-0-
S3 AUD H	551,879

	European Equity Portfolio	Eurozone Equity Portfolio	American Growth Portfolio
KLASSE			
A	1,670,878	10,654,170	8,774,167
A AUD H	30,926	209,625	-0-
A EUR H	-0-	-0-	369,965
A HKD H	53,355	-0-	-0-
A PLN H	-0-	4,315	225,342
A SGD H	60,648	5,516	40,399
A USD H	156,266	452,099	-0-
AD	60,537	-0-	4,466,851
AD AUD H	651,010	-0-	3,211,186
AD RMB H	-0-	-0-	10,778
AD SGD H	105,237	-0-	-0-
AD USD H	609,650	-0-	-0-
AD ZAR H	-0-	-0-	1,080,781
AR	-0-	807	-0-
AX	-0-	671,236	101,822
B	41,709	-0-	146,038
BD	-0-	-0-	643
BD AUD H	711	-0-	-0-
BD USD H	20,819	-0-	-0-
BD ZAR H	-0-	-0-	1,332
BX	-0-	85,217	6,787
C	180,860	356,179	1,250,424
C EUR H	-0-	-0-	35,239
C USD H	2,716	23,636	-0-
CX	-0-	31,015	-0-
ED	-0-	-0-	1,436,038
I	7,897,698	8,300,106	5,559,369
I EUR H	-0-	-0-	590,087
I GBP	533	533	4,883
I GBP H	-0-	-0-	47,032
I USD H	40,384	79,707	-0-
INN	-0-	58,211	-0-
IX	-0-	2,576	-0-
N	-0-	-0-	289,729
S	12,210	159,952	100
S EUR H	-0-	-0-	3,121,962
S1	842,362	26,873,515	9,180,315
S1 EUR H	-0-	-0-	187,868
S1 GBP	80	80	-0-
S1 USD H	-0-	2,325,363	-0-
S1N	-0-	106,812	-0-
S1N USD	-0-	136,950	-0-
S1NN	425,998	-0-	-0-
S1X	3,117,122	-0-	-0-
SD	311,901	-0-	281,492
SK	-0-	-0-	6,254,237

	All Market Income Portfolio	China A Shares Equity Portfolio
KLASSE		
A	1,839,311	9,870
A AUD H	-0-	1,000
A CAD H	-0-	867
A CHF H	730	-0-
A EUR	-0-	600
A EUR H	8,886	-0-
A HKD	175,757	-0-
A HKD H	-0-	776
A NZD H	-0-	1,000
A SGD H	867	933
A USD	-0-	667
A USD H	-0-	667
A2X	58,931	-0-
AD	38,196,298	-0-
AD AUD H	17,179,917	-0-
AD CAD H	3,439,962	-0-
AD EUR H	2,129,153	-0-
AD GBP H	3,846,500	-0-
AD HKD	33,827,875	779
AD HKD H	-0-	776
AD NZD H	3,387,540	-0-
AD RMB H	2,225	-0-
AD SGD H	200,272	926
AD USD H	-0-	668
AD ZAR H	2,836,121	-0-
AMG	720	-0-
AMG EUR H	649	-0-
ANN	679	-0-
ANN EUR H	611	-0-
AQG	715	-0-
AQG EUR H	644	-0-
AR EUR H	19,711	-0-
AX	174,014	-0-
B	10,372	-0-
B2X	25,475	-0-
BX	57,402	-0-
C	71,607	-0-
C2X	88,002	-0-
CD	3,730	-0-
CX	55,185	-0-
ED	3,237,691	-0-
ED AUD H	661,795	-0-
ED ZAR H	711,005	-0-
I	26,861	8,079
I CHF H	600	-0-
I EUR H	1,107	-0-
I GBP	-0-	8,325
I SGD H	867	-0-
I USD H	-0-	667
ID	334,970	-0-
IMG	720	-0-
IMG EUR H	649	-0-
INN	51,941	-0-
INN EUR H	614	-0-
INN GBP H	546	-0-

	All Market Income Portfolio	China A Shares Equity Portfolio
KLASSE		
IQG	714	-0-
IQG EUR H	644	-0-
N	13,702	-0-
ND	271,592	-0-
S	-0-	763,992
S USD	-0-	50,410
S1	9,163,234	67
S1 CHF H	100	-0-
S1 EUR	-0-	10,098
S1 EUR H	47,268	-0-
S1 GBP H	80	-0-
S1D JPY H	555,899	-0-
S1QG GBP H	86	-0-
SP1 USD	-0-	638,189

	Financial Credit Portfolio
KLASSE	
A	-0-
A AUD H	-0-
A CAD H	-0-
A EUR H	-0-
A GBP H	-0-
A HKD	-0-
A NZD H	-0-
A PLN H	-0-
A SGD H	-0-
A2	22,722
A2 CHF H	667
A2 EUR H	12,699
AD	-0-
AD AUD H	-0-
AD CAD H	-0-
AD GBP H	-0-
AD HKD	-0-
AD NZD H	-0-
AD SGD H	-0-
AT	711
I	-0-
I PLN H	-0-
I2	141,319
I2 CHF H	667
I2 EUR H	3,332,849
I2 GBP H	2,622
IT	3,802
S	43,917
S EUR H	90
S GBP H	80
S1	100
S1 EUR H	90
S1 GBP H	80
S1 JPY H	-0-
SA	-0-
ZT	1,357,322

	Sustainable Global Thematic Credit Portfolio
KLASSE	
A	-0-
A2	600
I	-0-
I2	600
I2 GBP H	533
I2 USD H	667
S	90
S1	174,820
S1 GBP H	80
S1 USD H	100
S1FN	-0-
S1FN GBP	-0-
S1FN USD	-0-

	International Health Care Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$1,107,523,108	$753,290,331	$515,934,419
Klasse			
A	$409.50	$332.76	$319.05
A EUR H	€16.91	€14.18	N/A
AD	$16.47	$13.74	N/A
AX	$464.83	$375.84	$358.54
B	$311.33	$255.52	$247.44
BX	$400.11	$323.51	$308.62
C	$374.48	$305.68	$294.39
ED	$18.34	$15.31	$15.04
I	$486.24	$391.97	$372.82
I GBP (1)	£17.59	N/A	N/A
S1	$163.37	$131.28	$124.50
S14 GBP (2)	£114.67	N/A	N/A
A — EUR *	€368.91	€298.01	€272.94
B — EUR *	€280.47	€228.84	€211.68
C — EUR *	€337.36	€273.76	€251.85
I — EUR *	€438.05	€351.04	€318.94
S1 — EUR *	€147.18	N/A	N/A

	International Technology Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$667,246,788	$397,758,728	$417,566,383
Klasse			
A	$459.00	$339.09	$328.96
A PLN H	PLN124.17	PLN93.74	N/A
B	$358.41	$267.44	$262.05
C	$423.27	$314.08	$306.08
E	$19.76	$14.75	N/A
I	$559.28	$409.89	$394.48
S1	$265.91	$194.11	$185.96
A — EUR *	€413.51	€303.68	€281.42
B — EUR *	€322.89	€239.51	€224.18
C — EUR *	€381.32	€281.28	€261.85
I — EUR *	€503.85	€367.09	€337.47

	Global Real Estate Securities Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$41,743,039	$45,899,751	$41,996,466
Klasse			
A	$22.06	$26.00	$24.53
AD	$11.59	$14.43	$14.35
AD AUD H	AUD10.70	AUD14.00	AUD14.05
AD NZD H	NZD10.92	NZD14.08	NZD14.11
AD SGD H	SGD11.22	SGD14.15	SGD14.08
B	$18.16	$21.63	$20.61
BD	$11.60	$14.43	$14.34
BD AUD H	AUD10.77	AUD14.08	AUD14.11
C	$17.19	$20.36	$19.29
I	$25.76	$30.13	$28.19
ID	$12.07	$15.00	$14.89
S1	$20.19	$23.51	$21.90
A — EUR *	€19.87	€23.29	€20.99
B — EUR *	€16.36	€19.37	€17.63
C — EUR *	€15.49	€18.23	€16.50
I — EUR *	€23.21	€26.98	€24.12
S1 — EUR *	€18.19	€21.06	€18.74

	Sustainable Global Thematic Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$837,582,384	$726,183,042	$847,168,288
Klasse			
A	$29.19	$25.10	$25.15
A AUD H	AUD35.03	AUD31.36	AUD31.85
A EUR H	€23.09	€20.47	€21.16
A SGD H	SGD23.25	SGD20.27	SGD20.54
AN	$29.23	$25.13	$25.17
AX	$85.58	$73.57	$73.71
AXX	$97.09	$83.05	$82.80
B	$23.01	$19.98	$20.22
B AUD H (3)	N/A	AUD28.70	AUD29.42
B CAD H	CAD21.61	CAD19.22	CAD19.73
BX	$64.39	$55.91	$56.59
BXX	$82.98	$70.98	$70.77
C	$28.72	$24.80	$24.96
CX	$78.38	$67.68	$68.12
I	$35.39	$30.18	$30.00
I EUR H	€24.81	€21.80	€22.33
IN	$35.40	$30.19	$30.01
IX	$103.25	$88.05	$87.52
S	$37.34	$31.50	$30.96
S GBP	£33.33	£27.46	£25.67
S1	$34.68	$29.45	$29.15
S1X	$112.44	$95.50	$94.52
SD	$137.25	$120.70	$123.59
SX	$123.86	$104.46	$102.68
A — EUR *	€26.30	€22.48	€21.52
AX — EUR *	€77.10	€65.89	€63.06
B — EUR *	€20.73	€17.89	€17.30
BX — EUR *	€58.01	€50.07	€48.41
C — EUR *	€25.87	€22.21	€21.35
CX — EUR *	€70.61	€60.61	€58.28
I — EUR *	€31.88	€27.03	€25.66
IN — EUR *	€31.89	N/A	N/A
IX — EUR *	€93.02	€78.86	€74.87
S — EUR *	€33.64	€28.21	€26.49
S1 — EUR *	€31.24	€26.37	€24.94
S1X — EUR *	€101.30	€85.53	€80.86
SX — EUR *	€111.58	€93.55	€87.84

	India Growth Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$133,252,453	$226,411,841	$270,072,804
Klasse			
A	$122.51	$174.67	$185.99
A PLN H	PLN67.31	PLN97.81	N/A
A SGD H	SGD12.64	SGD18.29	SGD19.65
AD AUD H	AUD9.69	AUD14.68	AUD16.15
AX	$109.77	$156.14	$165.90
B	$115.66	$166.55	$179.12
BX	$84.53	$121.48	$130.37
C	$107.39	$153.79	$164.50
I	$120.63	$170.60	$180.21
S	$12.05	$16.85	$17.55
S1	$12.73	$17.97	$18.89
A — EUR *	€110.37	€156.43	€159.11
AX — EUR *	€98.89	€139.84	€141.93
B — EUR *	€104.20	€149.16	€153.24
BX — EUR *	€76.15	€108.80	€111.53
C — EUR *	€96.75	€137.73	€140.73
I — EUR *	€108.67	€152.79	€154.17

	Euro High Yield Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	€348,813,401	€535,377,294	€564,251,417
Klasse			
A	€15.39	€16.20	€16.59
A2	€24.62	€25.29	€25.22
A2 CHF H	CHF16.35	CHF16.85	CHF16.88
A2 PLN H	PLN96.88	PLN98.77	N/A
A2 USD H	$17.63	$17.61	$17.06
AA	€12.34	€13.19	€13.73
AA AUD H	AUD11.89	AUD13.11	AUD13.69
AA HKD H	$84.98	$90.35	$93.88
AA RMB H	CNH83.95	CNH89.48	CNH93.31
AA SGD H	SGD12.56	SGD13.51	SGD14.07
AA USD H	$12.40	$13.21	$13.73
AR	€12.55	€13.41	€13.98
AT	€15.43	€16.25	€16.65
AT AUD H	AUD13.38	AUD14.49	AUD14.88
AT SGD H	SGD13.69	SGD14.50	SGD14.86
AT USD H	$13.69	$14.37	$14.69
B2	€22.23	€23.06	€23.24
C	€15.39	€16.20	€16.60
C2	€23.53	€24.27	€24.32
CT USD H	$13.63	$14.31	$14.63
I	€15.38	€16.19	€16.60
I2	€26.03	€26.59	€26.38
I2 CHF H	CHF16.92	CHF17.35	CHF17.28
I2 GBP H	£16.83	£17.27	£16.95
I2 USD H	$18.78	$18.67	$17.97
IT USD H	$13.68	$14.34	$14.68
NT USD H	$13.68	$14.35	$14.68
S	€28.32	€28.68	€28.21
S1	€26.65	€27.15	€26.86
S1 USD H	$19.43	$19.26	$18.50
A — USD *	$17.08	$18.09	$19.39
A2 — USD *	$27.33	$28.24	$29.48
AT — USD *	$17.13	$18.14	$19.46
B2 — USD *	$24.68	$25.75	$27.17
C — USD *	$17.08	$18.09	$19.40
C2 — USD *	$26.12	$27.10	$28.43
I — USD *	$17.07	$18.08	$19.40
I2 — USD *	$28.89	$29.69	$30.84
S — USD *	$31.44	$32.02	$32.98
S1 — USD *	$29.58	$30.32	$31.40

	US Small and Mid-Cap Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$53,359,648	$83,198,889	$198,726,775
Klasse			
A	$26.55	$31.46	$36.08
A AUD H (4)	AUD14.03	N/A	N/A
A EUR H	€24.70	€30.46	€36.01
A SGD H	SGD20.62	SGD25.02	SGD29.00
B	$23.98	$28.70	$33.24
C	$25.38	$30.20	$34.79
C EUR H	€23.69	€29.34	€34.84
I	$28.84	$33.89	$38.55
I EUR H	€26.68	€32.64	€38.27
S	$32.02	$37.23	$41.95
S EUR H	€29.63	€35.87	€41.64
S1	$29.68	$34.77	$39.45
S1 EUR H	€27.51	€33.55	€39.25
A — EUR *	€23.92	€28.18	€30.87
B — EUR *	€21.60	€25.70	€28.44
C — EUR *	€22.86	€27.05	€29.76
I — EUR *	€25.98	€30.35	€32.98
S — EUR *	€28.85	€33.34	€35.89
S1 — EUR *	€26.74	€31.14	€33.75

	Emerging Markets Multi-Asset Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$1,174,457,925	$1,854,347,221	$2,709,118,184
Klasse			
A	$14.35	$14.89	$15.96
A AUD H	AUD16.55	AUD17.84	AUD19.32
A CAD H	CAD15.66	CAD16.61	CAD18.06
A CHF H	CHF12.04	CHF12.93	CHF14.35
A EUR H	€12.52	€13.40	€14.83
A GBP H	£13.20	£14.12	£15.48
A SGD H	SGD15.56	SGD16.37	SGD17.74
AD	$10.46	$11.45	$12.97
AD AUD H	AUD9.59	AUD10.81	AUD12.36
AD CAD H	CAD9.85	CAD10.96	CAD12.50
AD EUR H	€10.21	€11.25	€12.79
AD GBP H	£10.08	£11.22	£12.80
AD RMB H	CNH86.03	CNH94.74	N/A
AD SGD H	SGD10.95	SGD12.08	SGD13.72
AD ZAR H	R75.29	R84.09	R96.76
AR	$11.97	$13.37	$15.17
AR EUR H	€10.91	€12.45	€14.15
B	$13.13	$13.76	$14.89
BD	$10.53	$11.53	$13.05
C	$13.79	$14.37	$15.47
ED	$11.85	$12.97	$14.69
ED AUD H (5)	AUD12.72	N/A	N/A
ED ZAR H (6)	R85.23	N/A	N/A
I	$15.45	$15.90	$16.91
I CHF H	CHF12.89	CHF13.73	CHF15.12
I EUR H	€13.49	€14.33	€15.73
I GBP (1)	£13.99	N/A	N/A
I GBP H	£14.16	£15.03	£16.35
ID	$9.51	$10.41	$11.80
ID GBP H	£11.39	£12.67	£14.46
N	$14.66	$15.29	$16.45
S	$16.87	$17.20	$18.11
S GBP H	£17.26	£18.14	£19.54
S1	$15.70	$16.14	$17.13
S1 JPY	¥8,852.00	¥9,144.00	¥9,744.00
S1 JPY H	¥8,490.00	¥8,935.00	¥9,746.00
S1D	$77.54	$84.81	$96.11
SD	$88.83	$97.17	$110.23
SQD GBP H	£11.91	£13.22	£15.11
A — EUR *	€12.93	€13.34	€13.65
I — EUR *	€13.92	€14.24	€14.47

	RMB Income Plus Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	CNH1,300,605,621	CNH1,495,869,447	CNH1,514,459,812
Klasse			
A2	CNH139.77	CNH136.41	CNH129.77
AR EUR	€11.83	€12.65	€13.16
AT	CNH95.94	CNH97.85	CNH97.26
C2	CNH134.31	CNH131.67	CNH125.83
CT	CNH96.57	CNH98.48	CNH97.89
I2	CNH146.89	CNH142.58	CNH134.90
IT	CNH96.70	CNH98.65	CNH98.07
S	CNH156.80	CNH151.10	CNH141.92
S1	CNH149.18	CNH144.54	CNH136.51
W2	CNH109.56	CNH106.17	CNH100.28
A2 — USD *	$19.58	$19.67	$20.24
A2 — EUR *	€17.64	€17.61	€17.33
AT — USD *	$13.44	$14.11	$15.17
C2 — USD *	$18.82	$18.99	$19.62
CT — USD *	$13.53	$14.20	$15.27
I2 — USD *	$20.58	$20.56	$21.04
I2 — EUR *	€18.54	€18.41	€18.01
IT — USD *	$13.55	$14.22	$15.30
S — USD *	$21.97	$21.79	$22.13
S — EUR *	€19.79	€19.51	€18.95
S1 — USD *	$20.90	$20.84	$21.29
S1 — EUR *	€18.83	€18.66	€18.23

	Short Duration High Yield Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$1,002,110,030	$954,414,744	$1,285,688,556
Klasse			
A2	$20.13	$19.92	$19.02
A2 CHF H	CHF15.86	CHF16.23	CHF16.03
A2 EUR H	€17.99	€18.33	€18.02
A2 GBP H	£18.86	£19.18	£18.65
A2 SEK H (7)	N/A	kr16.83	kr16.54
AA	$12.43	$12.97	$13.16
AA AUD H	AUD12.04	AUD12.83	AUD13.08
AA SGD H	SGD12.86	SGD13.48	SGD13.68
AR EUR H	€12.77	€13.60	€13.82
AT	$14.23	$14.65	$14.67
AT AUD H	AUD13.95	AUD14.66	AUD14.74
AT CAD H	CAD13.70	CAD14.23	CAD14.29
AT EUR H	€13.98	€14.47	€14.51
AT GBP H	£13.80	£14.41	£14.48
AT SGD H	SGD14.11	SGD14.60	SGD14.62
B2	$18.43	$18.41	$17.75
BT	$14.18	$14.61	$14.63
BT CAD H	CAD13.63	CAD14.15	CAD14.22
C2	$19.34	$19.22	$18.44
CT	$13.78	$14.19	$14.21
I2	$21.12	$20.78	$19.73
I2 CHF H	CHF16.54	CHF16.83	CHF16.54
I2 EUR H	€18.86	€19.13	€18.70
I2 GBP H	£19.79	£20.02	£19.37
IT	$13.92	$14.33	$14.35
IT EUR H	€13.74	€14.21	€14.25
IT GBP H	£14.40	£15.00	£15.08
IT SGD H	SGD14.51	SGD15.02	SGD15.04
N2	$17.56	$17.47	$16.77
NT	$13.64	$14.05	$14.07
S	$22.55	$22.04	$20.78
S1	$21.55	$21.16	$20.05
S1QD EUR H (8)	€95.05	N/A	N/A
W2 CHF H	CHF14.83	CHF15.07	CHF14.77

	Select US Equity Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$3,465,598,265	$4,033,034,423	$4,106,398,105
Klasse			
A	$36.17	$33.23	$32.83
A AUD H	AUD18.07	AUD17.46	AUD17.41
A CHF H	CHF21.40	CHF20.36	CHF20.78
A CZK H	CZK1,013.01	CZK960.03	CZK968.28
A EUR H	€32.20	€30.51	€31.08
A GBP H	£33.36	£31.75	£32.10
A PLN H	PLN101.69	PLN96.11	N/A
A SGD H	SGD33.96	SGD31.72	SGD31.67
AR	$19.36	$18.31	$18.67
AR EUR H	€18.97	€18.35	€18.72
C	$31.43	$29.01	$28.79
F	$39.06	$35.37	$34.45
F EUR H	€34.27	€31.99	€32.13
I	$38.72	$35.30	$34.60
I CHF H	CHF22.56	CHF21.29	CHF21.55
I EUR H	€34.50	€32.43	€32.77
I GBP H	£35.74	£33.75	£33.84
I SGD H	SGD27.00	SGD25.02	SGD24.78
N	$30.03	$27.72	$27.51
S	$42.84	$38.60	$37.40
S EUR H	€38.09	€35.53	€35.49
S GBP H	£39.64	£37.00	£36.67
S1	$40.14	$36.44	$35.57
S1 EUR H	€36.05	€33.70	€33.93
S1 GBP H	£37.11	£34.90	£34.86
S1 JPY	¥10,258.00	¥9,357.00	N/A
S1 JPY H	¥10,340.00	¥9,609.00	N/A
S1 SGD H	SGD129.14	SGD119.41	SGD117.80
W	$23.21	$21.00	$20.47
W CHF H	CHF20.71	CHF19.36	CHF19.50
W EUR H	€20.92	€19.53	€19.63
W GBP H	£21.28	£20.01	£19.95
W SGD H	SGD22.33	SGD20.55	SGD20.24
A — EUR *	€32.58	€29.76	€28.09
I — EUR *	€34.88	€31.61	€29.60
S1 — EUR *	€36.16	€32.64	€30.43
W — EUR *	€20.91	€18.81	€17.51

	Global Plus Fixed Income Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$1,057,002,284	$1,016,404,309	$892,788,028
Klasse			
1	$27.57	$26.37	$24.85
1 EUR H	€24.05	€23.60	€22.91
1 GBP H	£26.78	£26.15	£25.07
1D	$20.17	$19.61	$18.79
1D EUR H	€19.50	€19.14	€18.57
1D GBP H	£20.13	£19.74	£18.97
2	$27.72	$26.50	$24.95
2 EUR H	€24.14	€23.68	€22.97
2 GBP H	£26.86	£26.21	£25.12
A2	$19.23	$18.48	$17.49
A2 EUR H	€17.21	€16.97	€16.56
A2 SGD H	SGD16.94	SGD16.40	SGD15.65
AR EUR H	€14.84	€14.89	€14.51
AT	$17.31	$16.83	$16.12
AT AUD H	AUD16.70	AUD16.44	AUD15.78
AT CAD H	CAD16.68	CAD16.29	CAD15.62
AT EUR H	€16.48	€16.26	€15.86
AT GBP H	£16.54	£16.25	£15.67
AT SGD H	SGD16.70	SGD16.27	SGD15.58
BT	$17.18	$16.70	$16.01
BT CAD H	CAD16.34	CAD16.02	CAD15.44
C2	$18.55	$17.91	$17.03
C2 EUR H	€16.66	€16.50	€16.16
CT	$16.50	$16.04	$15.37
I2	$20.14	$19.24	$18.12
I2 EUR H	€18.10	€17.73	€17.19
I2 GBP H	£19.11	£18.65	£17.87
IK EUR H	€15.69	€15.42	€14.95
S	$20.21	$19.18	$17.92
S CAD H	CAD111.91	CAD107.21	CAD101.02
S GBP H	£29.27	£28.35	£26.95
S1	$19.47	$18.57	$17.44
S1 EUR H	€24.89	€24.37	€23.57
S1 NOK H (9)	N/A	kr1,776.77	kr1,695.21
SA	$105.93	$103.05	$98.79

	Select Absolute Alpha Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$766,531,109	$1,015,700,432	$1,079,987,339
Klasse			
A	$21.04	$20.11	$19.88
A AUD H	AUD18.59	AUD18.19	AUD18.11
A CHF H	CHF16.00	CHF15.70	CHF16.06
A EUR H	€19.38	€18.99	€19.37
A GBP H	£20.06	£19.60	£19.78
A PLN H	PLN101.82	PLN97.92	N/A
A SGD H	SGD21.06	SGD20.26	SGD20.20
C	$19.01	$18.23	$18.06
F	$24.83	$23.28	$22.67
F EUR H	€22.50	€21.62	€21.71
I	$22.39	$21.32	$20.93
I CHF H	CHF16.82	CHF16.42	CHF16.69
I EUR H	€20.45	€19.96	€20.23
I GBP H	£20.89	£20.26	£20.41
N	$18.10	$17.35	$17.19
S	$27.47	$25.47	$24.60
S EUR H	€24.72	€23.51	€23.42
S GBP H	£25.76	£24.48	£24.16
S1	$23.11	$21.64	$21.33
S1 EUR H	€20.71	€20.07	€20.29
S1 GBP H	£21.60	£20.93	£20.96
S1 JPY H	¥12,233.00	¥11,794.00	¥11,894.00
S13 EUR H (10)	€99.79	N/A	N/A
W	$16.08	$15.23	$14.90
W CHF H	CHF15.02	CHF14.62	CHF14.74
A — EUR *	€18.95	€18.01	€17.01
I — EUR *	€20.17	€19.09	€17.91

	Emerging Market Local Currency Debt Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$269,329,486	$259,958,778	$275,321,718
Klasse			
A2	$13.64	$13.33	$13.66
A2 CZK H	CZK854.29	CZK854.26	CZK893.40
A2 EUR H	€11.90	€11.96	€12.66
A2 PLN H	PLN98.44	PLN98.02	N/A
AA	$13.89	$14.72	N/A
AT (11)	$14.05	N/A	N/A
AT SGD H	SGD11.60	SGD12.10	SGD13.25
I2	$14.28	$13.87	$14.14
I2 EUR H	€12.44	€12.44	€13.11
S	$15.52	$14.93	$15.04
S1	$14.69	$14.23	$14.45
SA (12)	$90.74	N/A	N/A
ZT	$12.69	$13.19	$14.36

	Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$17,995,833	$22,249,167	$22,888,291
Klasse			
A2	$17.72	$17.05	$16.83
A2 AUD H	AUD19.04	AUD18.66	AUD18.56
A2 EUR H	€15.74	€15.57	€15.84
A2 SGD H	SGD17.17	SGD16.66	SGD16.58
AA	$13.13	$13.55	$14.33
AA AUD H	AUD12.86	AUD13.42	AUD14.28
AA CAD H	CAD13.01	CAD13.49	CAD14.29
AA EUR H	€13.03	€13.47	€14.27
AA GBP H	£13.00	£13.48	£14.27
AA SGD H	SGD13.05	SGD13.49	SGD14.27
AR EUR H	€11.70	€12.27	€12.96
AT	$12.12	$12.26	$12.72
AT AUD H	AUD11.67	AUD11.95	AUD12.47
AT CAD H	CAD11.78	CAD11.98	CAD12.47
AT EUR H	€11.88	€12.04	€12.52
AT GBP H	£11.86	£12.07	£12.55
AT SGD H	SGD11.84	SGD12.01	SGD12.48
B2	$16.27	$15.82	$15.77
BT	$12.20	$12.32	$12.76
BT AUD H	AUD11.74	AUD11.98	AUD12.49
BT CAD H	CAD11.90	CAD12.07	CAD12.53
BT EUR H	€11.97	€12.12	€12.58
BT GBP H	£11.98	£12.15	£12.61
C2	$17.07	$16.50	$16.36
C2 EUR H	€15.14	€15.04	€15.36
I2	$18.55	$17.76	$17.43
I2 EUR H	€16.47	€16.18	€16.37
I2 SGD H	SGD18.01	SGD17.37	SGD17.20
IT	$12.05	$12.20	$12.69
IT AUD H	AUD12.28	AUD12.58	AUD13.15
IT EUR H	€11.81	€11.98	€12.47
IT SGD H	SGD12.41	SGD12.60	SGD13.10
S	$20.00	$18.97	$18.45
S1	$18.94	$18.08	$17.70

	Emerging Market Corporate Debt Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$101,778,651	$107,760,119	$112,137,242
Klasse			
A2	$20.08	$20.20	$19.20
A2 AUD H	AUD19.60	AUD20.38	AUD19.50
A2 CAD H	CAD18.39	CAD18.82	CAD18.06
A2 EUR H	€17.98	€18.59	€18.21
A2 GBP H	£17.55	£18.17	£17.61
A2 SGD H	SGD18.26	SGD18.58	SGD17.82
AA	$12.16	$13.08	$13.28
AA AUD H	AUD11.65	AUD12.86	AUD13.12
AA SGD H	SGD12.25	SGD13.25	SGD13.45
AR EUR	€12.50	€13.38	€13.01
AT	$12.83	$13.54	$13.50
AT AUD H	AUD12.73	AUD13.77	AUD13.79
AT CAD H	CAD12.95	CAD13.81	CAD13.79
AT EUR H	€13.16	€13.92	€13.90
AT GBP H	£12.95	£13.87	£13.86
AT NZD H	NZD12.89	NZD13.87	NZD13.87
AT RMB H	CNH12.93	CNH13.68	CNH13.68
AT SGD H	SGD13.07	SGD13.86	SGD13.81
C2	$17.38	$17.56	$16.78
CT	$12.85	$13.55	$13.50
I2	$21.02	$21.02	$19.88
I2 EUR H	€18.78	€19.30	€18.82
IT	$12.83	$13.53	$13.50
N2	$17.27	$17.46	$16.70
NT	$12.91	$13.61	$13.57
S	$22.91	$22.68	$21.23
S1	$21.63	$21.56	$20.32

	US High Yield Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$118,576,458	$55,877,007	$124,677,594
Klasse			
A2	$20.95	$20.70	$20.22
A2 EUR H	€18.69	€19.05	€19.17
AT (13)	N/A	$15.62	$16.02
C2	$16.13	$16.01	$15.71
I2	$21.90	$21.53	$20.91
I2 EUR H	€19.57	€19.84	€19.86
N2	$15.76	$15.66	$15.38
NT	$13.71	$14.20	$14.56
S1	$22.52	$22.05	$21.37
S1 EUR H (14)	€96.20	N/A	N/A
ZT	$13.67	$14.18	$14.56

	Low Volatility Equity Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$3,828,265,565	$2,582,697,058	$1,833,883,065
Klasse			
A	$28.41	$27.73	$26.64
A AUD H	AUD24.43	AUD24.81	AUD23.98
A EUR (15)	€15.24	N/A	N/A
A EUR H	€25.54	€25.59	€25.32
A NZD H	NZD25.28	NZD25.57	NZD24.74
A PLN H	PLN99.08	PLN98.93	N/A
A SGD H	SGD23.50	SGD23.26	SGD22.55
AD	$19.00	$19.44	$19.37
AD AUD H	AUD18.02	AUD19.05	AUD19.07
AD CAD H	CAD17.33	CAD18.12	CAD18.16
AD EUR H	€17.82	€18.29	€18.30
AD GBP H	£17.36	£18.10	£18.15
AD NZD H	NZD18.29	NZD19.28	NZD19.32
AD RMB H	CNH95.53	CNH98.11	N/A
AD SGD H	SGD18.54	SGD19.13	SGD19.09
AD ZAR H (16)	R93.38	N/A	N/A
AR	$15.70	$16.33	$16.59
AR EUR H	€15.40	€16.30	€16.58
C	$19.49	$19.11	$18.44
ED	$15.45	$15.80	N/A
ED AUD H (17)	AUD13.81	N/A	N/A
ED ZAR H (18)	R90.16	N/A	N/A
I	$30.16	$29.20	$27.83
I EUR (15)	€15.37	N/A	N/A
I EUR H	€27.03	€26.87	€26.37
I GBP (15)	£15.56	N/A	N/A
I GBP H	£18.30	£18.30	£17.80
I SGD H	SGD23.26	SGD22.83	SGD21.95
N	$19.54	$19.16	$18.48
S	$32.21	$30.92	$29.24
S EUR H	€28.95	€28.53	€27.76
S1	$31.06	$29.97	$28.45
S1 EUR (15)	€102.87	N/A	N/A
S1 EUR H	€27.85	€27.58	€26.97
S1D (19)	$93.12	N/A	N/A
SD	$94.81	$96.95	N/A

	Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$1,300,455,023	$1,551,367,386	$393,811,960
Klasse			
A	$17.13	$17.78	$20.12
AD	$10.95	$11.86	$14.00
AD AUD H	AUD10.52	AUD11.76	AUD13.98
AD CAD H	CAD10.71	CAD11.81	CAD13.98
AD EUR H	€10.86	€11.80	€13.97
AD GBP H	£10.76	£11.81	£13.97
AD NZD H	NZD10.63	NZD11.78	NZD13.99
AD SGD H	SGD10.85	SGD11.84	SGD13.98
F	$87.96	$89.97	$100.35
F EUR H	€81.73	€85.83	€98.87
I	$18.00	$18.53	$20.81
I GBP H	£12.24	£12.95	£14.85
I SGD H	SGD12.70	SGD13.24	SGD15.02
S	$19.17	$19.53	$21.69
S EUR (20)	€91.66	N/A	N/A
S GBP	£23.72	£23.60	£24.92
S1	$18.23	$18.72	$20.95

	Global Dynamic Bond Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	£868,319,181	£730,141,891	£704,756,369
Klasse			
A2 CHF H	CHF14.49	CHF14.66	CHF14.65
A2 EUR H	€14.90	€15.03	€14.97
A2 SGD H	SGD16.16	SGD16.02	SGD15.60
A2 USD H	$16.59	$16.31	$15.76
AR EUR H	€13.06	€13.47	€13.64
I2	£16.24	£16.19	£15.83
I2 CHF H	CHF14.94	CHF15.05	CHF14.96
I2 EUR H	€15.43	€15.48	€15.32
I2 USD H	$17.10	$16.72	$16.06
S	£22.65	£22.39	£21.72
S EUR H	€16.17	€16.10	€15.81
S USD H	$18.04	$17.46	$16.64
S1	£16.63	£16.51	£16.08
S1 EUR H	€15.80	€15.77	€15.56
S1 SGD H (21)	SGD101.57	N/A	N/A
S1 USD H	$17.55	$17.10	$16.37
S1QD	£98.73	£100.17	N/A
SQD	£14.38	£14.59	£14.56

	Global Equity Income Portfolio (22)		
	9. Dezember 2019	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$4,998,326	$4,833,784	$5,405,836
Klasse			
A	$18.88	$17.39	$18.45
A EUR H	€17.14	€16.02	€17.51
A SGD H	SGD17.22	SGD15.92	SGD17.08
AD	$14.00	$13.25	$14.82
AD SGD H	SGD13.51	SGD12.80	SGD14.36
C	$18.39	$16.98	$18.09
C EUR H	€16.69	€15.64	€17.19
CD	$14.01	$13.26	$14.83
I	$19.78	$18.14	$19.10
I CHF H	CHF17.44	CHF16.26	CHF17.71
I EUR H	€17.96	€16.72	€18.14
I GBP H	£18.52	£17.16	£18.48
N	$18.39	$16.98	$18.09
ND	$14.01	$13.26	$14.83
S	$20.78	$18.98	$19.80
S1	$19.78	$18.14	$19.09
S1 GBP	£24.68	£23.54	£23.56

	Concentrated US Equity Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$896,786,290	$786,312,078	$794,684,107
Klasse			
A	$29.71	$25.80	$23.21
A AUD H	AUD29.80	AUD27.17	AUD24.79
A EUR	€28.76	€24.80	€21.32
A EUR H	€27.28	€24.49	€22.68
A SGD H	SGD29.30	SGD25.86	SGD23.55
AR EUR	€22.88	€20.43	€18.02
C	$28.88	$25.19	$22.76
I	$31.30	$26.96	$24.06
I AUD H	AUD31.28	AUD28.34	AUD25.64
I CHF H	CHF27.88	CHF24.90	CHF22.97
I EUR H	€28.63	€25.52	€23.45
I GBP (23)	£15.97	N/A	N/A
I GBP H	£29.19	£26.15	£23.87
I SGD H	SGD30.88	SGD27.03	SGD24.39
N	$28.88	$25.19	$22.76
S	$33.36	$28.47	$25.16
S EUR H	€30.50	€26.93	€24.51
S1	$31.73	$27.28	$24.29
S1 EUR H	€29.03	€25.82	€23.68
S1 GBP H	£24.75	£22.14	£20.15
SD	$120.70	$106.62	N/A
S — EUR *	€30.05	€25.50	€21.52
S1 — EUR *	€28.59	€24.43	€20.78

	Concentrated Global Equity Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$620,205,386	$236,504,073	$173,122,071
Klasse			
A	$27.12	$24.22	$23.45
A EUR H	€24.32	€22.33	€22.29
A SGD H	SGD22.38	SGD20.26	SGD19.84
AR EUR	€20.20	€18.68	€17.73
C	$19.61	$17.59	$17.11
I	$28.56	$25.30	$24.31
I CAD H	CAD20.23	CAD18.32	CAD17.87
I CHF H	CHF24.84	CHF22.70	CHF22.53
I EUR (24)	€15.50	N/A	N/A
I EUR H	€25.63	€23.36	€23.13
I GBP (23)	£16.01	N/A	N/A
I GBP H	£26.12	£23.91	£23.48
N	$21.65	$19.41	$18.88
S	$30.67	$26.88	$25.54
S EUR H	€27.47	€24.76	€24.24
S GBP	£33.39	£28.58	£25.83
S1	$28.99	$25.62	$24.56
S1 EUR H	€25.98	€23.62	€23.32
S1 — EUR *	€26.12	€22.94	€21.01

	Global Core Equity Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$1,024,945,202	$1,738,495,019	$1,632,497,200
Klasse			
A	$19.95	$19.12	$18.95
A AUD H	AUD19.25	AUD19.46	AUD19.53
A EUR H	€17.87	€17.54	€17.97
A SGD H	SGD19.23	SGD18.74	SGD18.80
AR EUR	€17.31	€16.89	€16.41
C	$19.44	$18.71	$18.63
I	$20.94	$19.90	$19.57
I AUD H	AUD20.12	AUD20.20	AUD20.11
I CHF H	CHF18.36	CHF17.85	CHF18.14
I EUR (14)	€14.50	N/A	N/A
I EUR H	€18.68	€18.19	€18.49
I GBP H	£19.08	£18.84	£18.94
I SGD H	SGD20.17	SGD19.48	SGD19.39
IX EUR	€302.84	€285.14	€267.11
N	$19.43	$18.70	$18.62
RX EUR	€268.69	€256.26	€243.17
S	$22.18	$20.88	$20.34
S EUR H	€19.85	€19.15	€19.28
S GBP H	£21.85	£21.38	£21.28
S NOK HP (25)	kr908.87	N/A	N/A
S1	$21.39	$20.26	$19.85
S1 EUR H	€19.01	€18.51	€18.79
S1 NOK HP (26)	kr1,254.47	N/A	N/A
S1X EUR (27)	N/A	€24.94	€23.30
SD	$95.11	$94.46	N/A
XX EUR (28)	N/A	€2,035.42	€1,903.77
XX GBP (29)	N/A	£2,037.77	£1,884.19

	Global Income Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$89,032,358	$129,417,172	$138,970,713
Klasse			
A2	$16.16	$15.86	$14.94
A2 AUD H	AUD15.45	AUD15.53	AUD14.69
A2 CAD H	CAD15.61	CAD15.54	CAD14.76
A2 CHF H	CHF14.61	CHF14.80	CHF14.44
A2 EUR H	€14.85	€14.98	€14.55
A2 GBP H	£15.11	£15.20	£14.57
A2 PLN H	PLN101.85	PLN101.52	N/A
A2 SGD H	SGD15.56	SGD15.40	SGD14.63
AA	$14.08	$14.63	$14.50
AA AUD H	AUD13.81	AUD14.60	AUD14.51
AA CAD H	CAD13.93	CAD14.60	CAD14.50
AA EUR H	€14.01	€14.59	€14.50
AA SGD H	SGD14.01	SGD14.60	SGD14.48
AT	$14.50	$14.85	$14.54
AT AUD H	AUD14.13	AUD14.72	AUD14.44
AT CAD H	CAD14.42	CAD14.90	CAD14.61
AT EUR H	€14.30	€14.69	€14.42
AT GBP H	£14.22	£14.72	£14.45
AT SGD H	SGD14.33	SGD14.73	SGD14.43
I2	$16.44	$16.04	$15.03
I2 AUD H	AUD15.77	AUD15.77	AUD14.84
I2 CAD H	CAD15.82	CAD15.66	CAD14.81
I2 CHF H	CHF14.82	CHF14.93	CHF14.48
I2 EUR H	€15.10	€15.15	€14.62
I2 GBP H	£15.50	£15.50	£14.79
I2 SGD H	SGD15.87	SGD15.63	SGD14.76
IT	$14.52	$14.88	$14.55
IT AUD H	AUD14.28	AUD14.88	AUD14.58
IT CAD H	CAD14.42	CAD14.90	CAD14.60
IT EUR H	€14.46	€14.85	€14.55
IT SGD H	SGD14.46	SGD14.87	SGD14.55
S	$111.93	$108.45	$100.92
S EUR H	€102.67	€102.23	€98.00
S GBP H	£104.68	£103.97	£98.47
S1	$110.26	$107.36	$100.39
S1 EUR H	€101.37	€101.45	€97.74
S1 GBP H	£103.39	£103.15	£98.22

	Alternative Risk Premia Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$41,021,722	$115,354,981	$241,841,377
Klasse			
F	$93.86	$96.38	$96.83
F EUR H	€87.63	€92.26	€95.59
F GBP H	£89.79	£93.93	£96.13
I	$13.93	$14.36	$14.49
I EUR H	€13.01	€13.75	€14.31
I GBP H	£13.32	£13.99	£14.39
S	$94.76	$96.87	$96.97
S1	$93.14	$95.88	$96.67
S1 EUR H	€86.99	€91.85	€95.45
S1 GBP H	£89.06	£93.47	£95.99
S1QD (30)	N/A	$96.57	$96.88
S1QD EUR H (31)	N/A	€92.48	€95.64
S3 AUD H (32)	AUD95.12	N/A	N/A

	European Equity Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	€396,731,620	€575,379,615	€555,582,015
Klasse			
A	€14.30	€15.88	€17.47
A AUD H	AUD19.01	AUD21.48	AUD23.17
A HKD H (33)	$79.92	N/A	N/A
A SGD H	SGD18.15	SGD19.88	SGD21.44
A USD H	$18.64	$20.12	$21.47
AD	€13.53	€15.62	€17.83
AD AUD H	AUD13.11	AUD15.68	AUD18.00
AD SGD H	SGD13.10	SGD15.23	SGD17.39
AD USD H	$13.47	$15.47	$17.59
B	€11.85	€13.29	€14.77
BD (34)	N/A	€16.13	€18.40
BD AUD H	AUD13.04	AUD15.60	AUD17.90
BD USD H	$13.92	$15.98	$18.17
C	€13.19	€14.71	€16.26
C USD H	$16.92	$18.34	$19.66
I	€17.94	€19.77	€21.57
I GBP (14)	£12.93	N/A	N/A
I USD H	$17.94	$19.20	$20.32
S	€20.78	€22.68	€24.52
S1	€91.02	€99.91	€108.66
S1 GBP (14)	£86.42	N/A	N/A
S1NN (35)	€102.06	N/A	N/A
S1X	€19.16	€21.02	€22.85
SD	€92.19	€106.57	€121.67
A — USD *	$15.87	$17.73	$20.42
B — USD *	$13.15	$14.84	$17.26
C — USD *	$14.64	$16.43	$19.01
I — USD *	$19.91	$22.07	$25.21
S — USD *	$23.07	$25.32	$28.66
S1 — USD *	$101.03	$111.56	$127.01
S1X — USD *	$21.27	$23.47	$26.71

	Eurozone Equity Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	€1,227,132,295	€1,203,582,501	€987,802,631
Klasse			
A	€22.50	€25.58	€27.64
A AUD H	AUD19.13	AUD22.31	AUD23.63
A PLN H	PLN84.27	PLN95.31	N/A
A SGD H	SGD18.95	SGD21.31	SGD22.58
A USD H	$19.50	$21.58	$22.63
AR	€11.37	€13.24	N/A
AX	€11.59	€13.17	€14.22
B	N/A	N/A	€25.58
BX	€9.39	€10.78	€11.76
C	€21.54	€24.59	€26.69
C USD H	$17.90	$19.91	$20.98
CX	€8.38	€9.56	€10.37
I	€24.32	€27.43	€29.40
I GBP (23)	£12.84	N/A	N/A
I USD H	$19.00	$20.87	$21.70
INN	€12.56	€14.27	N/A
IX	€13.73	€15.48	€16.58
S	€113.73	€127.02	€134.87
S1	€25.05	€28.15	€30.09
S1 GBP (36)	£84.15	N/A	N/A
S1 USD H	$21.28	$23.29	$24.16
S1N	€87.80	€99.54	N/A
S1N USD	$87.52	$99.63	N/A
A — USD *	$24.98	$28.56	$32.31
AX — USD *	$12.87	$14.71	$16.62
B — USD *	N/A	N/A	$29.90
BX — USD *	$10.42	$12.04	$13.75
C — USD *	$23.91	$27.46	$31.20
CX — USD *	$9.30	$10.67	$12.12
I — USD *	$27.00	$30.63	$34.37
IX — USD *	$15.24	$17.28	$19.38
S — USD *	$126.24	$141.83	$157.65
S1 — USD *	$27.81	$31.43	$35.17

	American Growth Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$4,832,171,569	$3,029,781,934	$2,521,218,288
Klasse			
A	$123.09	$95.59	$89.37
A EUR H	€60.53	€48.29	€46.55
A PLN H	PLN120.63	PLN95.30	N/A
A SGD H (37)	SGD15.46	N/A	N/A
AD	$31.05	$24.56	$23.32
AD AUD H	AUD29.69	AUD24.21	AUD23.25
AD RMB H	CNH117.91	CNH93.66	N/A
AD ZAR H	R203.35	R163.05	R156.06
AX	$141.13	$108.97	$101.29
B	$93.26	$73.15	$69.08
B EUR H (38)	N/A	€44.26	€43.06
BD	$30.89	$24.45	$23.30
BD AUD H (39)	N/A	AUD23.90	AUD23.03
BD ZAR H	R200.32	R160.84	R154.67
BX	$121.36	$93.70	$87.10
C	$106.28	$82.91	$77.86
C EUR H	€58.22	€46.66	€45.19
ED	$20.11	$15.92	$15.13
I	$148.26	$114.22	$105.95
I EUR H	€65.74	€52.03	€49.74
I GBP (40)	£17.58	N/A	N/A
I GBP H (41)	£17.76	N/A	N/A
N	$30.67	$23.93	$22.47
S (42)	$114.27	N/A	N/A
S EUR H	€27.45	€21.53	€20.41
S1	$157.18	$120.76	$111.71
S1 EUR H	€124.64	€98.41	N/A
SD	$221.40	$174.87	$164.82
SK	$129.27	$99.37	$91.97
A — EUR *	€110.89	€85.61	€76.46
B — EUR *	€84.02	€65.51	€59.10
C — EUR *	€95.75	€74.25	€66.61
I — EUR *	€133.57	€102.29	€90.64
S — EUR *	€102.94	N/A	N/A
S1 — EUR *	€141.60	€108.15	€95.57

	All Market Income Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$1,256,287,188	$291,505,250	$122,243,488
Klasse			
A	$16.05	$17.33	$16.90
A CHF H	CHF14.04	CHF15.65	CHF15.77
A EUR H	€14.44	€16.07	€16.13
A HKD	$107.21	$117.11	$114.18
A SGD H	SGD15.61	SGD17.05	SGD16.76
A2X	$20.84	$22.42	$21.81
AD	$10.55	$12.38	$13.06
AD AUD H	AUD10.11	AUD12.18	AUD12.92
AD CAD H	CAD10.19	CAD12.13	CAD12.83
AD EUR H	€10.35	€12.22	€12.93
AD GBP H	£10.22	£12.18	£12.90
AD HKD	$70.33	$83.54	$88.15
AD NZD H	NZD10.20	NZD12.22	NZD12.94
AD RMB H (4)	CNH92.41	N/A	N/A
AD SGD H	SGD10.32	SGD12.19	SGD12.86
AD ZAR H	R68.13	R81.27	R85.89
AMG	$13.00	$14.73	N/A
AMG EUR H	€12.35	€14.43	N/A
ANN	$13.45	$14.96	N/A
ANN EUR H	€12.77	€14.64	N/A
AQG	$12.99	$14.72	N/A
AQG EUR H	€12.34	€14.42	N/A
AR EUR H	€8.97	€10.97	€11.84
AX	$14.63	$16.14	$16.21
B	$15.16	$16.54	$16.28
B2X	$17.84	$19.40	$19.06
BX	$14.55	$16.05	$16.12
C	$15.52	$16.84	$16.49
C2X	$19.45	$21.03	$20.55
CD	$10.52	$12.34	$13.02
CX	$14.64	$16.16	$16.22
ED	$13.04	$15.30	N/A
ED AUD H	AUD12.41	AUD14.93	N/A
ED ZAR H	R83.32	R99.52	N/A
I	$16.76	$17.96	$17.37
I CHF H	CHF14.65	CHF16.21	CHF16.20
I EUR H	€15.08	€16.64	€16.58
I SGD H	SGD16.28	SGD17.64	SGD17.20
ID	$10.52	$12.35	$13.04
IMG	$13.18	$14.81	N/A
IMG EUR H	€12.52	€14.50	N/A
INN	$13.36	$14.96	N/A
INN EUR H	€12.76	€14.64	N/A
INN GBP H	£12.85	£14.74	N/A
IQG	$13.17	$14.80	N/A
IQG EUR H	€12.51	€14.50	N/A
IX	N/A	N/A	$16.41

	All Market Income Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Klasse			
N	$15.69	$17.03	$16.67
ND	$10.57	$12.41	$13.09
S1	$16.33	$17.46	$16.85
S1 CHF H	CHF90.52	CHF99.86	N/A
S1 EUR H	€90.90	€100.09	N/A
S1 GBP H	£91.69	£100.74	N/A
S1D JPY H	¥8,478.00	¥9,944.00	N/A
S1QG GBP H	£84.38	£97.40	N/A
A2X — EUR *	€18.77	€20.08	€18.66
AX — EUR *	€13.18	€14.45	€13.87
B2X — EUR *	€16.07	€17.37	€16.31
BX — EUR *	€13.11	€14.37	€13.79
C2X — EUR *	€17.52	€18.83	€17.58
CX — EUR *	€13.19	€14.47	€13.88
IX — EUR *	N/A	N/A	€14.04

	China A Shares Equity Portfolio	
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**
Nettovermögen	CNH973,309,526	CNH191,640,693
Klasse		
A	CNH107.93	CNH100.45
A AUD H (43)	AUD14.26	N/A
A CAD H (43)	CAD14.40	N/A
A EUR	€15.63	€14.97
A HKD H (44)	$104.37	N/A
A NZD H (43)	NZD14.39	N/A
A SGD H (43)	SGD14.47	N/A
A USD	$15.52	$14.90
A USD H (44)	$15.65	N/A
AD HKD (44)	$101.97	N/A
AD HKD H (44)	$104.36	N/A
AD SGD H (44)	SGD15.56	N/A
AD USD H (44)	$15.60	N/A
I	CNH110.34	CNH101.86
I GBP	£16.43	£15.29
I USD H (44)	$15.68	N/A
S	CNH152.48	CNH139.38
S USD (45)	$90.50	N/A
S1	CNH1,084.54	CNH998.85
S1 EUR (46)	€94.49	N/A
SP1 USD (47)	$177.82	N/A

	Financial Credit Portfolio		
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**	**31. Mai 2018**
Nettovermögen	$202,519,837	$120,336,852	$106,769,553
Klasse			
A2	$16.28	$15.47	$14.56
A2 CHF H	CHF15.19	CHF14.94	CHF14.54
A2 EUR H	€15.21	€14.98	€14.53
AT	$15.21	$14.97	$14.54
I2	$16.46	$15.56	$14.56
I2 CHF H	CHF15.36	CHF15.03	CHF14.54
I2 EUR H	€15.37	€15.07	€14.54
I2 GBP H	£15.45	£15.23	£14.54
IT	$15.24	$14.97	$14.54
S	$111.54	$104.56	$97.12
S EUR H	€104.19	€101.24	€96.94
S GBP H	£104.51	£102.37	£96.99
S1	$110.38	$104.02	$97.10
S1 EUR H	€103.13	€100.70	€96.92
S1 GBP H	£103.43	£101.82	£96.97
ZT	$101.41	$99.77	$96.93

	Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	
	31. Mai 2020	**31. Mai 2019**
Nettovermögen	€18,615,401	€17,562,433
Klasse		
A2 (48)	€15.17	N/A
I2	€15.91	€15.05
I2 GBP H (48)	£15.17	N/A
I2 USD H (48)	$15.47	N/A
S	€106.57	€100.37
S1	€106.11	€100.36
S1 GBP H (48)	£101.17	N/A
S1 USD H (48)	$103.18	N/A

* Nur für Informationszwecke.

(1) Auflegungsdatum 8. November 2019

(2) Auflegungsdatum 4. Dezember 2019

(3) Liquidiert am 20. Juni 2019 mit einem endgültigen NIW von AUD30.55

(4) Auflegungsdatum 11. März 2020

(5) Auflegungsdatum 5. November 2019

(6) Auflegungsdatum 1. Juli 2019

(7) Liquidiert am 29. November 2019 mit einem endgültigen NIW von kr17.17

(8) Auflegungsdatum 27. November 2019

(9) Liquidiert am 26. August 2019 mit einem endgültigen NIW von kr1,840.30

(10) Auflegungsdatum 21. Oktober 2019

(11) Auflegungsdatum 23. August 2019

(12) Auflegungsdatum 22. Januar 2020

(13) Liquidiert am 17. März 2020 mit einem endgültigen NIW von $13.72

(14) Auflegungsdatum 27. September 2019

(15) Auflegungsdatum 7. Juni 2019
(16) Auflegungsdatum 8. August 2019
(17) Auflegungsdatum 19. August 2019
(18) Auflegungsdatum 7. November 2019
(19) Auflegungsdatum 14. Oktober 2019
(20) Auflegungsdatum 5. Dezember 2019
(21) Auflegungsdatum 4. Juni 2019
(22) Der letzte Nettoinventarwert wurde am 9. Dezember 2019 berechnet
(23) Auflegungsdatum 23. August 2019
(24) Auflegungsdatum 25. Juli 2019
(25) Auflegungsdatum 19. November 2019
(26) Auflegungsdatum 17. März 2020
(27) Liquidiert am 5. März 2020 mit einem endgültigen NIW von €26.83
(28) Liquidiert am 13. März 2020 mit einem endgültigen NIW von €1,928.36
(29) Liquidiert am 3. Juli 2019 mit einem endgültigen NIW von £2,220.92
(30) Liquidiert am 27. Mai 2020 mit einem endgültigen NIW von $92.88
(31) Liquidiert am 27. Mai 2020 mit einem endgültigen NIW von €86.75
(32) Auflegungsdatum 13. Juni 2019
(33) Auflegungsdatum 30. Dezember 2019
(34) Liquidiert am 21. Januar 2020 mit einem endgültigen NIW von €18.40
(35) Auflegungsdatum 8. Mai 2019
(36) Auflegungsdatum 25. Oktober 2019
(37) Auflegungsdatum 14. Oktober 2019. Die Anteilklasse wurde am 2. Januar 2020 vollständig zurückgenommen und am 12. Februar 2020 neu aufgelegt.
(38) Liquidiert am 4. November 2019 mit einem endgültigen NIW von €48.55
(39) Liquidiert am 8. Oktober 2019 mit einem endgültigen NIW von AUD25.04
(40) Auflegungsdatum 2. August 2019
(41) Auflegungsdatum 20. Juni 2019
(42) Auflegungsdatum 16. April 2020
(43) Auflegungsdatum 13. Dezember 2019
(44) Auflegungsdatum 19. März 2020
(45) Auflegungsdatum 7. Januar 2020
(46) Auflegungsdatum 10. März 2020
(47) Auflegungsdatum 9. Dezember2019
(48) Auflegungsdatum 15. November 2019

ANMERKUNG A: Allgemeine Informationen
AB SICAV I (der „Fonds“) ist eine offene Investmentgesellschaft mit variablem Kapital *(société d'investissement à capital variable)*, die mit beschränkter Haftung gemäß der Rechtsprechung des Großherzogtums Luxemburg am 8. Juni 2006 gegründet wurde und gemäß Teil I des Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen zur gemeinsamen Anlage in übertragbare Wertpapiere (in der jeweils gültigen Fassung) (das „Gesetz von 2010“) eingetragen wurde. Der Fonds erfüllt die Voraussetzungen eines Organismus zur gemeinsamen Anlage in übertragbare Wertpapiere („OGAW“) im Sinne der Bedeutung von Artikel 1(2) der EG-Direktive 2009/65 vom 13. Juli 2009 (in der jeweils gültigen Fassung).

Der Fonds wird als Umbrella-Fonds mit separaten Anlagenpools (jeweils ein „Portefeuille“) verwaltet.

Der Fonds bietet verschiedene Anteilklassen innerhalb der einzelnen Portefeuilles an. Alle Anteile derselben Klasse haben dieselben Rechte in Bezug auf Dividenden und Rücknahmen.

AllianceBernstein India Growth Fund (Mauritius) Limited, eine mauritische Tochtergesellschaft, wurde gemäß den Gesetzen von Mauritius gegründet (die „mauritische Tochtergesellschaft“), um im Einklang mit den Anlagezielen und der Anlagepolitik des India Growth Portfolios Anlagen für das India Growth Portfolio in indische Wertpapiere vorzunehmen. Die mauritische Tochtergesellschaft ist eine Aktiengesellschaft und entspricht der Definition einer Investmentgesellschaft gemäß Abschnitt 2 des Mauritius Companies Act von 2001. Ihr wurde von der Financial Services Commission in Übereinstimmung mit dem Financial Services Act von 2007 eine allgemeine Geschäftslizenz der Kategorie 1 ausgestellt. Sie befindet sich zu 100% im Besitz des India Growth Portfolio und gibt ausschließlich einlösbare Anteile an diesem Portefeuille aus. Die Ergebnisse der mauritischen Tochtergesellschaft sind im Abschluss des Fonds enthalten. Am 8. Januar 2018 beschloss der Verwaltungsrat des Fonds (der „Verwaltungsrat“), die mauritische Tochtergesellschaft abzumelden, um diese zu liquidieren. AllianceBernstein L.P. (der „Anlageverwalter“) hat einen Plan zur Überführung der Anlagen aus der mauritischen Tochtergesellschaft in das India Growth Portfolio durchgeführt.

Nach Abschluss des Übergangsplans hat der Anlageverwalter damit begonnen, die mauritische Tochtergesellschaft aufzulösen.

Die folgende Tabelle zeigt den Beginn der Geschäftstätigkeit der einzelnen Portfolios sowie die zum 31. Mai 2020 angebotenen Anteilklassen:

AB SICAV I–	Geschäftsaufnahme	Angebotene Anteilklassen
International Health Care Portfolio	1. September 2006	A, A EUR H, AD, AX, B, BX, C, ED, I, I GBP, S1 & S14 GBP
International Technology Portfolio	1. September 2006	A, A PLN H, B, C, E, I & S1
Global Real Estate Securities Portfolio	1. September 2006	A, AD, AD AUD H, AD NZD H, AD SGD H, B, BD, BD AUD H, C, I, ID & S1
Sustainable Global Thematic Portfolio	1. September 2006	A, A AUD H, A EUR H, A SGD H, AN, AX, AXX, B, B CAD H, BX, BXX, C, CX, I, I EUR H, IN, IX, S, S GBP, S1, S1X, SD & SX
India Growth Portfolio.	31. Oktober 2009	A, A PLN H, A SGD H, AD AUD H, AX, B, BX, C, I, S & S1
Euro High Yield Portfolio	15. März 2010	A, A2, A2 CHF H, A2 PLN H, A2 USD H, AA, AA AUD H, AA HKD H, AA RMB H, AA SGD H, AA USD H, AR, AT, AT AUD H, AT SGD H, AT USD H, B2, C, C2, CT USD H, I, I2, I2 CHF H, I2 GBP H, I2 USD H, IT USD H, NT USD H, S, S1 & S1 USD H
US Small and Mid-Cap Portfolio.	15. März 2010	A, A AUD H, A EUR H, A SGD H, B, C, C EUR H, I, I EUR H, S, S EUR H, S1 & S1 EUR H
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio . .	1. Juni 2011	A, A AUD H, A CAD H, A CHF H, A EUR H, A GBP H, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD RMB H, AD SGD H, AD ZAR H, AR, AR EUR H, B, BD, C, ED, ED AUD H, ED ZAR H, I, I CHF H, I EUR H, I GBP, I GBP H, ID, ID GBP H, N, S, S GBP H, S1, S1 JPY, S1 JPY H, S1D, SD & SQD GBP H
RMB Income Plus Portfolio.	23. Mai 2011	A2, AR EUR, AT, C2, CT, I2, IT, S, S1 & W2

AB SICAV I–	Geschäftsaufnahme	Angebotene Anteilklassen
Short Duration High Yield Portfolio	29. Juli 2011	A2, A2 CHF H, A2 EUR H, A2 GBP H, AA, AA AUD H, AA SGD H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR H, AT GBP H, AT SGD H, B2, BT, BT CAD H, C2, CT, I2, I2 CHF H, I2 EUR H, I2 GBP H, IT, IT EUR H, IT GBP H, IT SGD H, N2, NT, S, S1, S1QD EUR H & W2 CHF H
Select US Equity Portfolio	28. Oktober 2011	A, A AUD H, A CHF H, A CZK H, A EUR H, A GBP H, A PLN H, A SGD H, AR, AR EUR H, C, F, F EUR H, I, I CHF H, I EUR H, I GBP H, I SGD H, N, S, S EUR H, S GBP H, S1, S1 EUR H, S1 GBP H, S1 JPY, S1 JPY H, S1 SGD H, W, W CHF H, W EUR H, W GBP H & W SGD H
Global Plus Fixed Income Portfolio	1. Februar 2012	1, 1 EUR H, 1 GBP H, 1D, 1D EUR H, 1D GBP H, 2, 2 EUR H, 2 GBP H, A2, A2 EUR H, A2 SGD H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR H, AT GBP H, AT SGD H, BT, BT CAD H, C2, C2 EUR H, CT, I2, I2 EUR H, I2 GBP H, IK EUR H, S, S CAD H, S GBP H, S1, S1 EUR H & SA
Select Absolute Alpha Portfolio	2. März 2012	A, A AUD H, A CHF H, A EUR H, A GBP H, A PLN H, A SGD H, C, F, F EUR H, I, I CHF H, I EUR H, I GBP H, N, S, S EUR H, S GBP H, S1, S1 EUR H, S1 GBP H, S1 JPY H, S13 EUR H, W & W CHF H
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	22. Februar 2012	A2, A2 CZK H, A2 EUR H, A2 PLN H, AA, AT, AT SGD H, I2, I2 EUR H, S, SA, S1 & ZT
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	8. Februar 2012	A2, A2 AUD H, A2 EUR H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA GBP H, AA SGD H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR H, AT GBP H, AT SGD H, B2, BT, BT AUD H, BT CAD H, BT EUR H, BT GBP H, C2, C2 EUR H, I2, I2 EUR H, I2 SGD H, IT, IT AUD H, IT EUR H, IT SGD H, S & S1
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	22. Februar 2012	A2, A2 AUD H, A2 CAD H, A2 EUR H, A2 GBP H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA SGD 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, C2, CT, I2, I2 EUR H, IT, N2, NT, S & S1
US High Yield Portfolio	29. März 2012	A2, A2 EUR H, C2, I2, I2 EUR H, N2, NT, S1, S1 EUR H & ZT

AB SICAV I–	Geschäftsaufnahme	Angebotene Anteilklassen
Low Volatility Equity Portfolio	12. Dezember 2012	A, A AUD H, A EUR, A EUR H, A NZD H, A PLN 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, AR, AR EUR H, C, ED, ED AUD H, ED ZAR H, I, I EUR, I EUR H, I GBP, I GBP H, I SGD H, N, S, S EUR H, S1, S1 EUR, S1 EUR H, S1D & SD
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	14. März 2014	A, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD NZD H, AD SGD H, F, F EUR H, I, I GBP H, I SGD H, S, S EUR, S GBP & S1
Global Dynamic Bond Portfolio	16. Mai 2014	A2 CHF H, A2 EUR H, A2 SGD H, A2 USD H, AR EUR H, I2, I2 CHF H, I2 EUR H, I2 USD H, S, S EUR H, S USD H, S1, S1 EUR H, S1 SGD H, S1 USD H, S1QD & SQD
Concentrated US Equity Portfolio	24. Dezember 2013	A, A AUD H, A EUR, A EUR H, A SGD H, AR EUR, C, I, I AUD H, I CHF H, I EUR H, I GBP, I GBP H, I SGD H, N, S, S EUR H, S1, S1 EUR H, S1 GBP H & SD
Concentrated Global Equity Portfolio	24. Dezember 2013	A, A EUR H, A SGD H, AR EUR, C, I, I CAD H, I CHF H, I EUR, I EUR H, I GBP, I GBP H, N, S, S EUR H, S GBP, S1 & S1 EUR H
Global Core Equity Portfolio	14. Juli 2014	A, A AUD H, A EUR H, A SGD H, AR EUR, C, I, I AUD H, I CHF H, I EUR, I EUR H, I GBP H, I SGD H, IX EUR, N, RX EUR, S, S EUR H, S GBP H, S NOK HP, S1, S1 EUR H, S1 NOK HP & SD
Global Income Portfolio	5. Mai 2017	A2, A2 AUD H, A2 CAD H, A2 CHF H, A2 EUR H, A2 GBP H, A2 PLN H, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA SGD H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR H, AT GBP H, AT SGD H, I2, I2 AUD H, I2 CAD H, I2 CHF H, I2 EUR H, I2 GBP H, I2 SGD H, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT SGD H, S, S EUR H, S GBP H, S1, S1 EUR H & S1 GBP H
Alternative Risk Premia Portfolio	12. Dezember 2017	F, F EUR H, F GBP H, I, I EUR H, I GBP H, S, S1, S1 EUR H, S1 GBP H & S3 AUD H
European Equity Portfolio	7. Mai 2018	A, A AUD H, A HKD H, A SGD H, A USD H, AD, AD AUD H, AD SGD H, AD USD H, B, BD AUD H, BD USD H, C, C USD H, I, I GBP, I USD H, S, S1, S1 GBP, S1NN, S1X & SD
Eurozone Equity Portfolio	7. Mai 2018	A, A AUD H, A PLN H, A SGD H, A USD H, AR, AX, BX, C, C USD H, CX, I, I GBP, I USD H, INN, IX, S, S1, S1 GBP, S1 USD H, S1N & S1N USD

AB SICAV I–	Geschäftsaufnahme	Angebotene Anteilklassen
American Growth Portfolio	7. Mai 2018	A, A EUR H, A PLN H, A SGD H, AD, AD AUD H, AD RMB H, AD ZAR H, AX, B, BD, BD ZAR H, BX, C, C EUR H, ED, I, I EUR H, I GBP, I GBP H, N, S EUR H, S, S1, S1 EUR H, SD & SK
All Market Income Portfolio	7. Mai 2018	A, A CHF H, A EUR H, A HKD, A SGD H, A2X, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD NZD H, AD RMB H, AD SGD H, AD ZAR H, AMG, AMG EUR H, ANN, ANN EUR H, AQG, AQG EUR H, AR EUR H, AX, B, B2X, BX, C, C2X, CD, CX, ED, ED AUD H, ED ZAR H, I, I CHF H, I EUR H, I SGD H, ID, IMG, IMG EUR H, INN, INN EUR H, INN GBP H, IQG, IQG EUR H, N, ND, S1, S1 CHF H, S1 EUR H, S1 GBP H, S1D JPY H & S1QG GBP H
China A Shares Equity Portfolio	3. Dezember 2018	A, A AUD H, A CAD H, A EUR, A HKD H, A NZD H, A SGD H, A USD, A USD H, AD HKD, AD HKD H, AD SGD H, AD USD H, I, I GBP, I USD H, S, S USD, S1, S1 EUR & SP1 USD
Financial Credit Portfolio	15. Mai 2018	A2, A2 CHF H, A2 EUR H, AT, I2, I2 CHF H, I2 EUR H, I2 GBP H, IT, S, S EUR H, S GBP H, S1, S1 EUR H, S1 GBP H & ZT
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	16. Mai 2019	A2, I2, I2 GBP H, I2 USD H, S, S1, S1 GBP H & S1 USD H

ANMERKUNG B: Relevante Bilanzierungsgrundsätze
Der Jahresabschluss wurde in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Bestimmungen in Luxemburg erstellt. Die Abschlüsse für das AB ESG Responsible Global Factor Portfolio und das Multi-Sector Credit Portfolio wurden nicht nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung erstellt, da diese Portefeuilles am 29. Mai 2020 bzw. 30. Juni 2020 (Datum des zum Zwecke des Abschlusses verwendeten NIW) vom Verwaltungsrat geschlossen wurden. Es folgt eine Zusammenfassung der relevanten Bilanzierungsgrundsätze der Portefeuilles.

1. Bewertung

1.1 Anlagen in Wertpapiere
An einer Börse notierte oder an einem anderen regulierten 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 bewertet, der auf Basis von Marktnotierungen ermittelt wird, oder, wenn die Marktnotierungen nicht leicht verfügbar sind bzw. als unzuverlässig angesehen werden, zu ihrem „angemessenen Wert", wie mithilfe der von den Verwaltungsratsmitgliedern der Verwaltungsgesellschaft (der „Verwaltungsrat") festgelegten und allgemein überwachten Verfahren bestimmt.

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 („NIW") des Portefeuilles verwendet werden, daher von den notierten oder veröf-

fentlichten Kursen derselben Wertpapiere abweichen. Derzeit ist die Bewertung zum angemessenen Wert nur auf bestimmte Aktienwerte und Terminkontrakte anwendbar.

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 würde.

Für Portefeuille-Wertpapiere, die vorwiegend an US-amerikanischen und indischen 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 Portefeuille-Wertpapiere beeinflussen.

Rententitel (i), Wertpapiere, die an keiner Börse notiert sind oder an keinem regulierten Markt gehandelt werden (ii), und Wertpapiere, die an einer Börse oder einem regulierten Markt nur sehr schwach gehandelt werden (iii), werden zum letzten Angebotskurs bewertet, der von den Hauptmarktmachern bereitgestellt wird. Wenn es keinen solchen Marktkurs gibt oder wenn dieser Marktkurs nicht repräsentativ für den Marktwert eines Wertpapiers ist, erfolgt die Bewertung des Wertpapiers in einer Weise, die den beizulegenden Zeitwert widerspiegelt, wie mithilfe der vom Verwaltungsrat und den Verwaltungsratsmitgliedern der Verwaltungsgesellschaft festgelegten und allgemein überwachten Verfahren bestimmt.

US-Staatstitel und alle anderen Schuldinstrumente, die eine verbleibende Laufzeit von höchstens 60 Tagen besitzen, werden im Allgemeinen von einem unabhängigen Kursdienst zum Marktkurs bewertet, sofern ein Marktkurs zur Verfügung steht. Wenn kein Marktkurs zur Verfügung steht, werden die Wertpapiere zum Buchwert bewertet. Diese Methode wird häufig für kurzfristige Wertpapiere benutzt, die eine ursprüngliche Laufzeit von höchstens 60 Tagen 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. Zu den Faktoren, die das Komitee berücksichtigt, gehören unter anderem eine Verschlechterung der Bonität des Emittenten oder wesentliche Veränderungen der Zinssätze.

Im Freiverkehr gehandelte („OTC“) Swaps und sonstige Derivate werden täglich in erster Linie mittels unabhängiger Preisstellungsdienste, auf Basis von Marktdaten unabhängiger Bewertungsmodelle und mittels unabhängiger Broker-Dealer oder Kontrahenten bewertet.

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 börsennotierte 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 Finanzterminkontrakte 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 Portefeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine gekaufte Kaufoption ausgeübt wird, erhöht der Optionspreis die Kostenbasis des Wertpapiers oder der vom jeweiligen Portefeuille 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 Portefeuille 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 Portefeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine verkaufte

Verkaufsoption ausgeübt wird, senkt der Optionspreis die Kostenbasis des vom jeweiligen Portefeuille gekauften Wertpapiers oder der Fremdwährung. Börsennotierte Kauf- oder Verkaufsoptionen, die von einem Portefeuille gekauft wurden, werden zum letzten Verkaufspreis bewertet. Falls kein Verkauf stattgefunden hat an dem Tag, werden die Wertpapiere zum letzten Rücknahmepreis an dem Tag bewertet.

1.6 Anlagen in andere Organismen für gemeinsame Anlagen („OGA")
Anlagen in andere OGA werden auf Grundlage des letzten verfügbaren NIW 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 „Veränderung 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 Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens erfasst. Die im Voraus bezahlten oder erhaltenen Prämien werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens als Kosten oder Erlöse ausgewiesen und linear über die Laufzeit des Vertrages abgeschrieben. Abgrenzungen abgeschriebener, im Voraus bezahlter Prämien auf Credit-Default-Swaps sind in den „Swap-Erträgen" enthalten, bis die Position verkauft wird. Danach sind die abgeschriebenen, im Voraus bezahlten Prämien in den realisierten Gewinnen und (Verlusten) aus Swaps enthalten. Bei allen anderen Swap-Typen sind die abgeschriebenen, im Voraus bezahlten Prämien in den realisierten Gewinnen und (Verlusten) aus Swaps enthalten. Schwankungen des Werts von Swap-Kontrakten werden als eine Komponente der Änderungen der nicht realisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesen.

Zu den in der Zusammensetzung des Fondsvermögens angegebenen „Für Swap-Kontrakte bezahlten/(erhaltenen) Vorabgebühren" zählen bezahlte (erhaltene) Gebühren auf im Freiverkehr gehandelte Credit-Default-Swaps und eine Einschuss-/Nachschusszahlung, die hinsichtlich der zentral abgerechneten Credit-Default-Swaps noch zu begleichen ist.

2. Gründungskosten
Die Gründungskosten für die folgenden Portfolios werden linear zu folgenden Daten abgeschrieben.

AB SICAV I–	Datum
China A Shares Equity Portfolio	Oktober 2020
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	Mai 2024

Die Gründungskosten anderer Portfolios wurden in früheren Jahren vollständig abgeschrieben.

In Bezug auf das Global Income Portfolio, das Alternative Risk Premia Portfolio und das Financial Credit Portfolio verzichtete der Anlageverwalter auf ihm zustehende Beträge im Zusammenhang mit den Gründungskosten. Daher wurden die aufgeschobenen Gründungskosten für die obigen Portefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 abgeschrieben.

3. Zuteilungsmethode
Die Erträge und Aufwendungen (mit Ausnahme der klassenspezifischen Verwaltungs- und Vertriebsgebühren) der „Renten"- und „Misch"-Portefeuilles des Fonds 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 Grundlage des Werts des prozentualen Anteils an den umlaufenden Anteilen der einzelnen Klassen zugewiesen.

Für alle Portefeuilles werden die realisierten und unrealisierten Gewinne und Verluste täglich auf Grundlage des Werts des prozentualen Anteils an den umlaufenden Anteilen der einzelnen Klassen zugewiesen.

Klassenspezifische Verwaltungs-, Verwaltungsgesellschafts- und Vertriebsgebühren sowie realisierte und 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 Anteilinhaber 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 denominiert ist, werden unter Anwendung des Mittelwerts zwischen dem letzten erhältlichen Kauf- und Verkaufspreis umgerechnet. Fremdwährungsgeschäfte werden zu dem am Transaktionstag geltenden Wechselkurs in die Währung des jeweiligen Portfolios 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 Geschäftsjahres geltenden Wechselkursen dargestellt wird. Dem Jahresabschluss wurden folgende Kurse zugrunde gelegt: der Kassakurs von 0.9009 und der Durchschnittskurs von 0.9042 für USD zu EUR, der Kassakurs von 7.1378 und der Durchschnittskurs von 7.0225 für USD zu CNH sowie der Kassakurs von 0.8097 und der Durchschnittskurs von 0.7926 für USD zu GBP.

Die in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene „Währungsberichtigung" ergibt sich aus der Differenz der Wechselkurse, die für die Umrechnung des konsolidierten Nettovermögens zu Beginn des Geschäftjahres, der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten und der Aufwands- und Ertragsrechnung sowie der Aufstellung über die Veränderung des Fondsvermögens verwendet werden.

5. Anlageerträge und Anlagetransaktionen
Dividendenerträge 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 Jahresabschlusses 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 Jahresabschlusses sowie die berichteten Einnahmen und Auslagen während des Geschäftsjahres auswirken. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen.

7. Swing Pricing-Anpassung
(Die folgenden Angaben gelten für alle Portefeuilles mit Ausnahme des Sustainable Global Thematic Portfolio und des Global Equity Income Portfolio)

Der Verwaltungsrat hat allen Anteilinhabern des Fonds mitgeteilt, dass mit Wirkung vom 2. November 2015 eine Politik zur Anpassung des Nettoinventarwerts (NIW) eingeführt wurde, die auch als „Swing Pricing" bekannt ist. Gemäß dieser Politik kann der NIW eines Portefeuilles angepasst werden, um die Auswirkungen der geschätzten Transaktionskosten, Preisabschläge und Gebühren, die durch die Kauf- und Rücknahmeaktivitäten der Anteilinhaber entstehen, widerzuspiegeln. Swing Pricing wird automatisch angewendet, 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 NIW der Anteile des jeweiligen Portefeuilles um einen Betrag nach oben oder unten korrigiert, der im Allgemeinen höchstens 2% des jeweiligen NIW 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 Finanzmarktbedingungen im Zusammenhang mit der COVID-19-Krise haben zu einer Weitung der Geld-Brief-Spanne bei bestimmten Wertpapieren und folglich zu höheren Transaktionskosten für den Fonds geführt. Das Swing-Pricing-Komitee ist der Ansicht, dass die aktuellen allgemeinen Swing-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. Gemäß den „FAQ CSSF on Swing Pricing Mechanism" beschloss der Verwaltungsrat, dem Swing-Pricing-Komitee zu gestatten, über die Swing-Schwellenwerte hinauszugehen, wenn es dies für das betreffende Portfolio als angemessen erachtet, um sicherzustellen, dass die übrigen Anteilinhaber des Fonds nicht von den aktuellen Transaktionskosten im Zusammenhang mit der COVID-19-Krise betroffen sind.

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

Alle dem Swing Pricing unterliegenden Portefeuilles, mit Ausnahme des All Market Total Return Portfolio, des Sustainable European Thematic Portfolio, des Emerging Market Local Currency Debt Portfolio und des Sustainable Global Thematic Credit Portfolio, haben im Berichtszeitraum ihren Nettoinventarwert angepasst. Zum 31. Mai 2020 wurde der Nettoinventarwert der folgenden Portefeuilles angepasst:

– Select Absolute Alpha Portfolio;
– Eurozone Equity Portfolio.

ANMERKUNG C: Steuern
Als Luxemburger *société d'investissement à capital variable* (SICAV) unterliegt der Fonds in Luxemburg nach den derzeit geltenden Steuergesetzen keiner Einkommen-, Quellen- oder Kapitalertragsteuer.

Der Fonds unterliegt jedoch der Luxemburger *taxe d'abonnement*, einer jährlichen Steuer in Höhe von 0.05%, die vierteljährlich auf das am Quartalsende festgestellte Gesamtnettovermögen berechnet wird und zahlbar ist. Der Satz beträgt 0.01% für institutionellen Anlegern vorbehaltene Anteilklassen im Sinne von Artikel 174 des Gesetzes von 2010. Dividenden, Zinsen und Kapitalgewinne aus Portefeuille-Wertpapieren, die in bestimmten Ländern emittiert wurden, unterliegen unter Umständen Quellen- oder Kapitalertragsteuern, die von diesen Ländern erhoben werden.

Indien
Ertragsausschüttungen an die mauritische Tochtergesellschaft in Form von Zinsen aus ihren Anlagen in Schuldtitel von indischen Unternehmen sollten einer Quellensteuer von 5% bis 20% unterliegen. Dividenden, die der mauritischen Tochtergesellschaft aus ihren Anlagen in Aktientitel von indischen Unternehmen gezahlt werden, sollten keiner Quellensteuer unterliegen. Jegliche Kapitalgewinne aus der Veräußerung der Anlagen der mauritischen Tochtergesellschaft in Indien sollten keiner Quellensteuer unterliegen. Die Regierungen von Indien und Mauritius haben ein Protokoll unterzeichnet, das das Steuerabkommen zwischen Indien und Mauritius abändert. Das neu ausgehandelte Abkommen verdeutlicht die Anwendbarkeit einer allgemeinen Regel zur Verhinderung von Steuerumgehungen („GAAR", General Anti-avoidance Rule) auf eine Tochtergesellschaft in Mauritius, die als in Mauritius steueransässig angesehen wird. Gemäß dem Protokoll hat Indien das Recht zur Besteuerung von Kapitalerträgen aus der Veräußerung von Aktien, die am oder nach dem 1. April 2017 an einem in Indien ansässigen Unternehmen erworben werden, wobei Aktien, die am oder vor dem 31. März 2017 erworben wurden, im Rahmen des Bestandsschutzes von der Kapitalertragssteuer befreit sind.

Volksrepublik („VR") China

Körperschaftssteuer
Aufgrund der Anlage in Aktien von in der VRC ansässigen Unternehmen (einschließlich chinesischer A-, B- und

H-Aktien), auf RMB lautende Unternehmens- und Staatsanleihen, Anlagefonds und Optionsscheine, die an den Börsen in der VRC oder den Interbankenmärkten der VRC notiert sind, unterliegt ein Portfolio möglicherweise der Quellensteuer und anderen in der VRC geltenden Steuern.

Da keine genauen Richtlinien vorliegen, ist nicht sicher, ob im Hinblick auf Erträge aus chinesischen Quellen, die aus Anlagen in Anleihen, Aktien und anderen Wertpapieren in der VRC stammen, der RQFII oder das entsprechende anlegende Portfolio als Steuerzahler gilt.

Falls der RQFII als Steuerzahler gilt, werden alle gegenüber dem RQFII erhobenen chinesischen Steuern erstattet und letztendlich von den entsprechenden Portfolios des Fonds getragen.

Falls die betreffenden Portfolios als Steuerzahler gelten, unterliegen die betreffenden Portfolios der chinesischen Körperschaftssteuer in Höhe von 25% ihrer weltweiten steuerpflichtigen Einkünfte, falls sie als steuerpflichtige, in der VR China ansässige Unternehmen gelten. Falls das Portfolio als nicht steuerlich ansässiges Unternehmen behandelt wird, das eine Niederlassung oder einen dauerhaften Sitz („PE“) in der VRC hat, unterliegen die diesem dauerhaften Sitz zuzuschreibenden Erträge aus chinesischen Quellen der Körperschaftssteuer in Höhe von 25%.

Gemäß dem chinesischen Körperschaftssteuergesetz vom 1. Januar 2008 unterliegt ein ausländisches Unternehmen ohne dauerhaftem Sitz in der VRC der Quellensteuer zum derzeitigen Satz von 10% auf Erträge aus chinesischen Quellen, insbesondere in Bezug auf passive Erträge (z. B. Dividenden, Zinsen, Gewinne aus der Übertragung von Vermögenswerten etc.), vorbehaltlich der Anwendung von Steuererleichterungen aufgrund von Abkommen.

Der Anlageverwalter beabsichtigt, die Portfolios so zu verwalten und zu betreiben, dass die Portfolios und der Fonds für Zwecke der Körperschaftssteuer nicht als steuerpflichtiges, in der VR China ansässiges Unternehmen oder als nicht steuerlich ansässiges Unternehmen mit dauerhaftem Sitz in der VR China behandelt werden, wobei dies jedoch nicht garantiert werden kann. Es wird daher erwartet, dass die Portfolios lediglich der Quellensteuer von 10% unterliegen, soweit das betreffende Portfolio direkte Erträge aus chinesischen Quellen in Bezug auf seine Anlagen in Anleihen, Aktien und andere Wertpapiere in der VRC erzielt.

Kapitalbeteiligungen
Mit Genehmigung des chinesischen Staatsrats haben die chinesische Steuerverwaltung, das chinesische Finanzministerium und die Aufsichtsbehörde China Securities Regulatory Commission gemeinsam das Caishui [2014] 79 („Rundschreiben 79“) veröffentlicht, um die Behandlung der Quellensteuer im Hinblick auf von QFII und RQFII erzielte Gewinne aus der Veräußerung von Aktienanlagen, einschließlich Aktien chinesischer Unternehmen, zu klären. Gemäß dem Rundschreiben 79 sind QFII und RQFII im Hinblick auf Gewinne aus der Veräußerung von Aktienanlagen, einschließlich Aktien chinesischer Unternehmen (z. B. A- und B-Aktien), über die QFII- bzw. RQFII-Anlagequote mit Wirkung vom 17. November 2014 vorübergehend von der Quellensteuer befreit.

Steuerliche Offenlegung in der VRC in Bezug auf Stock Connect
Zusätzlich zur Anlage in A-Aktien über die RQFII-Quote des RQFII-Inhabers kann der Fonds ein Engagement in A-Aktien über Stock Connect eingehen, das am 17. November 2014 mit dem Handel begonnen hat.

Mit Genehmigung des chinesischen Staatsrats haben die chinesische Steuerverwaltung, das chinesische Finanzministerium und die Aufsichtsbehörde CSRC gemeinsam das Caishui [2014] 81 („Rundschreiben 81“) veröffentlicht, um die steuerliche Behandlung der chinesischen Connect-Wertpapiere in der VRC zu klären. Das Rundschreiben 81 trat am 17. November 2014 in Kraft.

Gemäß Rundschreiben 81 unterliegt der Fonds in der VRC der folgenden einkommensteuerlichen Behandlung in Bezug auf den Northbound-Handel im Rahmen von Stock Connect (d. h. den Handel mit bestimmten A-Aktien an der SSE):

– Er ist vorübergehend von der chinesischen Quellensteuer in Bezug auf Gewinne aus der Veräußerung von A-Aktien befreit.

– Er unterliegt der chinesischen Quellensteuer von 10% in Bezug auf Dividenden aus A-Aktien.

– Er unterliegt der chinesischen Stempelsteuer von 0.1% in Bezug auf den Verkauf von A-Aktien (d. h., der Kauf von A-Aktien unterliegt nicht der chinesischen Stempelsteuer).

Anleger sollten beachten, dass Stock Connect nur eine begrenzte bzw. keine Geschichte hat. Dementsprechend sind die geltenden Steuervorschriften für die an der Stock Connect gehandelten chinesischen Connect-Wertpapiere noch nicht lange in Kraft und könnten in Zukunft geändert werden. Anleger sollten in Bezug auf alle Fragen im Zusammenhang mit chinesischen Connect-Wertpapieren ihren Steuerberater konsultieren.

Das Finanzministerium der VR China und die Steuerbehörde der VR China haben am 22. November 2018 gemeinsam Caishui [2018] 108 („Rundschreiben 108“) herausgegeben, um die dreijährige Steuerbefreiung zu klären, die in der VR China für von ausländischen institutionellen Anlegern verdiente Anleihezinsen gewährt wird. Gemäß Rundschreiben 108 sind ausländische institutionelle Anleger vorübergehend in der VR China von der Quellensteuer und der Mehrwertsteuer in Bezug auf Zinserträge aus Anleihen befreit, die auf dem inländischen Anleihemarkt im Zeitraum vom 7. November 2018 bis 6. November 2021 erzielt werden. In Rundschreiben 108 wird die rückwirkende Steuererhebung auf vor dem 7. November 2018 verdiente Anleihezinsen nicht erwähnt.

ANMERKUNG D: Ausschüttungen
Der Verwaltungsrat (nachfolgend der „Verwaltungsrat“) beabsichtigt derzeit nicht, auf die Anteile der folgenden Portefeuilles Dividenden auszuschütten: International Technology Portfolio, US Small, Mid-Cap Portfolio und Select Absolute Alpha Portfolio. Aus diesem Grunde werden alle Erträge und realisierten Gewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

Für das International Health Care Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, AX, B, BX, C, I, S, S1 und S14 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AD, ED und ID beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Global Real Estate Securities Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, B, C, I, 1, 2, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AD, BD, ID und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klasse 1D beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind. 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. Die Dividenden werden automatisch in weitere Anteile derselben Klasse wiederangelegt, es sei denn, der Anteilinhaber entscheidet sich für eine Barausschüttung, indem er der Verwaltungsgesellschaft entsprechende schriftliche Anweisungen erteilt. Die wiederanzulegenden Dividenden werden an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt, die diese zu dem an diesem Datum geltenden Angebotspreis bzw. zu einem anderen Preis, der gelegentlich vereinbart werden kann, am Datum der Dividendenzahlung in den Erwerb von Anteilen investiert. Dem Anteilinhaber wird ein Beleg über die Wiederanlage zugesandt. Nicht wiederangelegte Dividenden werden am Datum der Dividendenzahlung per Post oder auf anderem Wege zugestellt. Der Fonds kann keine Haftung für die Nichtzustellung oder verspätete Zustellung von Dividenden übernehmen.

Für das Sustainable Global Thematic Portfolio:

– Für Anteile der Klasse SD beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

- Für sämtliche Anteile mit Ausnahme der Anteile der Klasse SD beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

Für das India Growth Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, AX, B, BX, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt. Im Ermessen des Verwaltungsrats können Sonderdividenden erklärt werden.

– Für Anteile der Klassen AD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Euro High Yield Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, C und I (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, 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, CT, IT, NT und ZT (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 Anteile der Klasse AA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten.

– Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt der Verwaltungsrat, jährlich Dividenden zu erklären und auszuschütten.

– Für Anteile der Klasse AM beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für Anteile der Klasse AM eine feste Ausschüttungsquote von 7% je Anteil (auf Jahresbasis) aufrechtzuerhalten. Daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren. Der Verwaltungsrat wird die Höhe der Erträge und Aufwendungen auf Ebene der Anteilklasse AM sowie die feste prozentuale Ausschüttungsquote regelmäßig überprüfen und ggf. beschließen, die feste prozentuale Ausschüttungsquote zu erhöhen oder zu senken.

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

Für das Emerging Markets Multi-Asset Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, B, C, I, N, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AD, BD, ED, ID, SD und S1D (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klasse SQD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden vierteljährlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden.

Für das RMB Income Plus Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A2, C2, I2, S, S1 und W2 beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AT, CT, IT und ZT beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) vorgenommen werden und können auch realisierte und unrealisierte Gewinne und Kapital umfassen, das der jeweiligen Anteilklasse zuzuschreiben ist. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

Für das Short Duration High Yield Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, N2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT und NT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse I (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klasse AA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. 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 Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

– Für Anteile der Klasse AM beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für Anteile der Klasse AM eine feste Ausschüttungsquote von 5% je Anteil (auf Jahresbasis) aufrechtzuerhalten. Daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren. Der Verwaltungsrat wird die Höhe der Erträge und Aufwendungen auf Ebene der Anteilklasse AM sowie die feste prozentuale Ausschüttungsquote regelmäßig überprüfen und ggf. beschließen, die feste prozentuale Ausschüttungsquote zu erhöhen oder zu senken.

– 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 Select US Equity Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, AW, C, I, N, S, S1, F und W (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) vorgenommen werden und können auch realisierte und unrealisierte Gewinne und Kapital umfassen, das der jeweiligen Anteilklasse zuzuschreiben ist. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

Für das Global Plus Fixed Income Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A2, C2, I2, 1, 2, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT und 1D (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 Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich 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 Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

– Für Anteile der Klasse SA beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten.

– Für Anteile der Klasse IK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, 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 Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden vierteljährlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, eine stabile Auszahlung je Anteil für Anteile der Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) aufrechtzuerhalten.

Für das Emerging Market Local Currency Debt Portfolio:

– Für Anteile der Klassen AA und SA beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten.

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

– Für Anteile der Klassen AT, CT, IT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüt-

tungsquote 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 Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

Für das Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio:

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

– Für Anteile der Klasse AA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich 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 Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

– Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Emerging Market Corporate Debt Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A2, C2, I2, N2, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klasse AA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich 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 Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

– Für Anteile der Klasse AM beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für Anteile der Klasse AM eine feste Ausschüttungsquote von 5% je Anteil (auf Jahresbasis) aufrechtzuerhalten. Daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren. Der Verwaltungsrat wird die Höhe der Erträge und Aufwendungen auf Ebene der Anteilklasse AM sowie die feste prozentuale Ausschüttungsquote regelmäßig überprüfen und ggf. beschließen, die feste prozentuale Ausschüttungsquote zu erhöhen oder zu senken.

– Für Anteile der Klassen AT, CT, IT, NT und ZT (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 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 US High Yield Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A2, C2, I2, N2, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klasse AA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich 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 Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

– Für Anteile der Klassen AT, CT, IT, NT und ZT (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 Low Volatility Equity Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, C, I, N, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AD, ED, SD und S1D (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) vorgenommen werden und können auch realisierte und unrealisierte Gewinne und Kapital umfassen, das der jeweiligen Anteilklasse zuzuschreiben ist. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

Für das Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, C, F, I, N, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klasse AD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten.

Für das Global Dynamic Bond Portfolio:

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

– Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich 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 Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

– Für Anteile der Klassen SQD und 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 Global Equity Income Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, C, I, N, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AD, CD und ND (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Concentrated US Equity Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, C, N, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klasse SD beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprüng-

lich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Concentrated Global Equity Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, C, I, N, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klasse AD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Global Core Equity Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, C, N, I, S, S1, S1X, IX, RX und XX (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und HP) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klasse SD beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

- Für die Anteile der Klasse INN beabsichtigt der Verwaltungsrat, eine jährliche Dividende zu erklären und auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entspricht, die dieser Anteilklasse zuzuschreiben sind.

Für das Global Income Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A2, I2, L2, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AT, IT und LT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, monatlich Dividenden zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen, die der jeweiligen Anteilklasse zuzurechnen sind.

– Für Anteile der Klasse AA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich 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 Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

Für das Alternative Risk Premia Portfolio:

– Für Anteile der Klassen F, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen SQD und S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) kann der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen auf der Grundlage des den einzelnen Anteilklassen zuzurechnenden Nettoertrags des Portefeuilles Dividenden festsetzen und auszahlen. Der Verwaltungsrat 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 auf diese Anteile entfallenden Nettoerträge und realisierten Nettogewinne den zur Zahlung festgesetzten Betrag übersteigen, wird die Überschussrendite im

jeweiligen Nettoinventarwert dieser Anteile berücksichtigt. Die Zahlung kann aus dem Nettoertrag des Portefeuilles und, falls dieser ausgeschöpft wird, aus nicht realisierten Kapitalgewinnen oder Kapital erfolgen.

– Für Anteile der Klasse S3 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) darf der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen eine jährliche Dividende erklären und ausschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entspricht, die dieser Anteilklasse zuzuschreiben sind, jedoch nur dann, wenn die jährliche Dividende nicht dazu führt, dass der Nettoinventarwert anschließend niedriger als der Nettoinventarwert am Ende des vorherigen Geschäftsjahres ist.

Für das European Equity Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S, S1 und S1X (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AD, BD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klasse S1NN beabsichtigt der Verwaltungsrat, eine jährliche Dividende zu erklären und auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entspricht, die dieser Anteilklasse zuzuschreiben sind.

Für das Eurozone Equity Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, AX, B, BX, C, CX, I, IX, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klassen ANN und INN beabsichtigt der Verwaltungsrat, 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 S1N darf der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen eine jährliche Dividende erklären und ausschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entspricht, die dieser Anteilklasse zuzuschreiben sind.

Für das American Growth Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, AX, B, BX, C, I, N, S, S1 und SK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AD, BD, ED und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat 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. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das All Market Income Portfolio:

– Für Anteile der Klassen AD, BD, CD, ED, ID, ND, S1D und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

– Für Anteile der Klassen AX, BX, CX und IX 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 Anteile der Klassen A, B, C, A2X, B2X, C2X, I, N und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

– Für Anteile der Klassen AMG und IMG (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote je Anteil errechnet sich aus dem Bruttertrag (vor Abzug von Gebühren und Kosten) des Portefeuilles. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, die Ausschüttungsquote regelmäßig zu überprüfen und bei Bedarf anzupassen.
– Für Anteile der Klassen AQG, IQG und S1QG (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden vierteljährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote je Anteil errechnet sich aus dem Bruttertrag (vor Abzug von Gebühren und Kosten) des Portefeuilles. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, die Ausschüttungsquote regelmäßig zu überprüfen und bei Bedarf anzupassen.
– Für Anteile der Klassen ANN und INN (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, 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 das China A Shares Equity Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A, I, S, SP1 USD, S1 und Z (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.
– Für Anteile der Klasse AD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Der Verwaltungsrat beabsichtigt, für diese Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Aus dem Kapital vorgenommene Ausschüttungen könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren.

Für das Financial Credit Portfolio:

– Für Anteile der Klassen AT, IT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, monatlich Dividenden zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen, die der jeweiligen Anteilklasse zuzurechnen sind.
– Für Anteile der Klassen A2, I2, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.

Für das Sustainable Global Thematic Credit Portfolio:

– Für Anteile der Klassen A2, I2, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.
– Für Anteile der Klassen INN und S1NN (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, 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.

Der Verwaltungsrat 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 Managementgebühr. Gemäß den Bedingungen des Anlageverwaltungsvertrags zahlt die Verwaltungsgesellschaft dem 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 SICAV I–	Anteilklasse	%
Global Real Estate Securities Portfolio	Klasse A	2.00%
	Klasse AD	2.00%
	Klasse AD AUD H	2.00%
	Klasse AD NZD H	2.00%
	Klasse AD SGD H	2.00%
	Klasse B	3.00%
	Klasse BD	3.00%
	Klasse BD AUD H	3.00%
	Klasse C	2.45%
	Klasse I	1.20%
	Klasse ID	1.20%
	Klasse S1	0.75%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Sustainable Global Thematic Portfolio	Klasse A	2.25%
	Klasse A AUD H	2.25%
	Klasse A EUR H	2.25%
	Klasse A SGD H	2.25%
	Klasse AN	2.25%
	Klasse B	3.25%
	Klasse B AUD H(a)	3.25%
	Klasse B CAD H	3.25%
	Klasse C	2.70%
	Klasse I	1.45%
	Klasse I EUR H	1.45%
	Klasse IN	1.45%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S GBP	0.15%
	Klasse S1	0.85%
	Klasse S1X	0.85%
	Klasse SD	0.15%
	Klasse SX	0.15%
Euro High Yield Portfolio	Klasse A	1.50%
	Klasse A2	1.50%
	Klasse A2 CHF H	1.50%
	Klasse A2 PLN H	1.50%
	Klasse A2 USD H	1.50%
	Klasse AA	1.50%
	Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse AA HKD H	1.50%
	Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse AA USD H	1.50%
	Klasse AR	1.50%
	Klasse AT	1.50%
	Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse AT USD H	1.50%
	Klasse B2	2.50%
	Klasse C	1.95%
	Klasse C2	1.95%
	Klasse CT USD H	1.95%
	Klasse I	0.95%
	Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 CHF H	0.95%
	Klasse I2 GBP H	0.95%
	Klasse I2 USD H	0.95%
	Klasse IT USD H	0.95%
	Klasse NT USD H	1.95%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.75%
	Klasse S1 USD H	0.75%
US Small and Mid-Cap Portfolio	Klasse A	2.00%
	Klasse A AUD H	2.00%
	Klasse A EUR H	2.00%
	Klasse A SGD H	2.00%
	Klasse B	3.00%
US Small and Mid-Cap Portfolio	Klasse C	2.45%
	Klasse C EUR H	2.45%
	Klasse I	1.20%
	Klasse I EUR H	1.20%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S1	0.90%
	Klasse S1 EUR H	0.90%
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	Klasse A	1.95%
	Klasse A AUD H	1.95%
	Klasse A CAD H	1.95%
	Klasse A CHF H	1.95%
	Klasse A EUR H	1.95%
	Klasse A GBP H	1.95%
	Klasse A SGD H	1.95%
	Klasse AD	1.95%
	Klasse AD AUD H	1.95%
	Klasse AD CAD H	1.95%
	Klasse AD EUR H	1.95%
	Klasse AD GBP H	1.95%
	Klasse AD RMB H	1.95%
	Klasse AD SGD H	1.95%
	Klasse AD ZAR H	1.95%
	Klasse AR	1.95%
	Klasse AR EUR H	1.95%
	Klasse B	2.95%
	Klasse BD	2.95%
	Klasse C	2.40%
	Klasse ED	2.95%
	Klasse ED AUD H	2.95%
	Klasse ED ZAR H	2.95%
	Klasse I	1.15%
	Klasse I CHF H	1.15%
	Klasse I EUR H	1.15%
	Klasse I GBP	1.15%
	Klasse I GBP H	1.15%
	Klasse ID	1.15%
	Klasse ID GBP H	1.15%
	Klasse N	2.40%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse S1	0.95%
	Klasse S1 JPY	0.95%
	Klasse S1 JPY H	0.95%
	Klasse S1D	0.95%
	Klasse SD	0.15%
	Klasse SQD GBP H	0.15%
RMB Income Plus Portfolio	Klasse A2	1.50%
	Klasse AR EUR	1.50%
	Klasse AT	1.50%
	Klasse C2	1.95%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
RMB Income Plus Portfolio	Klasse CT	1.95%
	Klasse I2	0.95%
	Klasse IT	0.95%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.70%
	Klasse W2	0.95%
Short Duration High Yield Portfolio	Klasse A2	1.45%
	Klasse A2 CHF H	1.45%
	Klasse A2 EUR H	1.45%
	Klasse A2 GBP H	1.45%
	Klasse A2 SEK H(b)	1.45%
	Klasse AA	1.45%
	Klasse AA AUD H	1.45%
	Klasse AA SGD H	1.45%
	Klasse AR EUR H	1.45%
	Klasse AT	1.45%
	Klasse AT AUD H	1.45%
	Klasse AT CAD H	1.45%
	Klasse AT EUR H	1.45%
	Klasse AT GBP H	1.45%
	Klasse AT SGD H	1.45%
	Klasse B2	2.45%
	Klasse BT	2.45%
	Klasse BT CAD H	2.45%
	Klasse C2	1.90%
	Klasse CT	1.90%
	Klasse I2	0.90%
	Klasse I2 CHF H	0.90%
	Klasse I2 EUR H	0.90%
	Klasse I2 GBP H	0.90%
	Klasse IT	0.90%
	Klasse IT EUR H	0.90%
	Klasse IT GBP H	0.90%
	Klasse IT SGD H	0.90%
	Klasse N2	2.00%
	Klasse NT	2.00%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1QD EUR H	0.65%
	Klasse W2 CHF H	0.90%
Select US Equity Portfolio	Klasse A	2.10%
	Klasse A AUD H	2.10%
	Klasse A CHF H	2.10%
	Klasse A CZK H	2.10%
	Klasse A EUR H	2.10%
	Klasse A GBP H	2.10%
	Klasse A PLN H	2.10%
	Klasse A SGD H	2.10%
	Klasse AR	2.10%
	Klasse AR EUR H	2.10%
	Klasse C	2.55%
	Klasse F	0.76%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Select US Equity Portfolio	Klasse F EUR H	0.76%
	Klasse I	1.30%
	Klasse I CHF H	1.30%
	Klasse I EUR H	1.30%
	Klasse I GBP H	1.30%
	Klasse I SGD H	1.30%
	Klasse N	2.55%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse S1	0.90%
	Klasse S1 EUR H	0.90%
	Klasse S1 GBP H	0.90%
	Klasse S1 JPY	0.90%
	Klasse S1 JPY H	0.90%
	Klasse S1 SGD H	0.90%
	Klasse W	0.40%
	Klasse W CHF H	0.40%
	Klasse W EUR H	0.40%
	Klasse W GBP H	0.40%
	Klasse W SGD H	0.40%
Global Plus Fixed Income Portfolio	Klasse 1	0.90%
	Klasse 1 EUR H	0.90%
	Klasse 1 GBP H	0.90%
	Klasse 1D	0.90%
	Klasse 1D EUR H	0.90%
	Klasse 1D GBP H	0.90%
	Klasse 2	0.90%
	Klasse 2 EUR H	0.90%
	Klasse 2 GBP H	0.90%
	Klasse A2	1.50%
	Klasse A2 EUR H	1.50%
	Klasse A2 SGD H	1.50%
	Klasse AR EUR H	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 SGD H	1.50%
	Klasse BT	2.50%
	Klasse BT CAD H	2.50%
	Klasse C2	1.95%
	Klasse C2 EUR H	1.95%
	Klasse CT	1.95%
	Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%
	Klasse I2 GBP H	0.95%
	Klasse IK EUR H	0.95%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S CAD H	0.15%
	Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse S1	0.65%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Global Plus Fixed Income Portfolio	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1 NOK H(c)	0.65%
	Klasse SA	0.15%
Select Absolute Alpha Portfolio	Klasse A	2.25%
	Klasse A AUD H	2.25%
	Klasse A CHF H	2.25%
	Klasse A EUR H	2.25%
	Klasse A GBP H	2.25%
	Klasse A PLN H	2.25%
	Klasse A SGD H	2.25%
	Klasse C	2.70%
	Klasse F	0.81%
	Klasse F EUR H	0.81%
	Klasse I	1.45%
	Klasse I CHF H	1.45%
	Klasse I EUR H	1.45%
	Klasse I GBP H	1.45%
	Klasse N	2.70%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse S1	1.15%
	Klasse S1 EUR H	1.15%
	Klasse S1 GBP H	1.15%
	Klasse S1 JPY H	1.15%
	Klasse S13 EUR H	0.99%
	Klasse W	1.45%
	Klasse W CHF H	1.45%
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	Klasse A2	1.75%
	Klasse A2 CZK H	1.75%
	Klasse A2 EUR H	1.75%
	Klasse A2 PLN H	1.75%
	Klasse AA	1.75%
	Klasse AT	1.75%
	Klasse AT SGD H	1.75%
	Klasse I2	1.20%
	Klasse I2 EUR H	1.20%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.85%
	Klasse SA	0.15%
	Klasse ZT	0.01%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	Klasse A2	1.60%
	Klasse A2 AUD H	1.60%
	Klasse A2 EUR H	1.60%
	Klasse A2 SGD H	1.60%
	Klasse AA	1.60%
	Klasse AA AUD H	1.60%
	Klasse AA CAD H	1.60%
	Klasse AA EUR H	1.60%
	Klasse AA GBP H	1.60%
	Klasse AA SGD H	1.60%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	Klasse AR EUR H	1.60%
	Klasse AT	1.60%
	Klasse AT AUD H	1.60%
	Klasse AT CAD H	1.60%
	Klasse AT EUR H	1.60%
	Klasse AT GBP H	1.60%
	Klasse AT SGD H	1.60%
	Klasse B2	2.60%
	Klasse BT	2.60%
	Klasse BT AUD H	2.60%
	Klasse BT CAD H	2.60%
	Klasse BT EUR H	2.60%
	Klasse BT GBP H	2.60%
	Klasse C2	2.05%
	Klasse C2 EUR H	2.05%
	Klasse I2	1.05%
	Klasse I2 EUR H	1.05%
	Klasse I2 SGD H	1.05%
	Klasse IT	1.05%
	Klasse IT AUD H	1.05%
	Klasse IT EUR H	1.05%
	Klasse IT SGD H	1.05%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.80%
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	Klasse A2	1.75%
	Klasse A2 AUD H	1.75%
	Klasse A2 CAD H	1.75%
	Klasse A2 EUR H	1.75%
	Klasse A2 GBP H	1.75%
	Klasse A2 SGD H	1.75%
	Klasse AA	1.75%
	Klasse AA AUD H	1.75%
	Klasse AA SGD H	1.75%
	Klasse AR EUR	1.75%
	Klasse AT	1.75%
	Klasse AT AUD H	1.75%
	Klasse AT CAD H	1.75%
	Klasse AT EUR H	1.75%
	Klasse AT GBP H	1.75%
	Klasse AT NZD H	1.75%
	Klasse AT RMB H	1.75%
	Klasse AT SGD H	1.75%
	Klasse C2	2.20%
	Klasse CT	2.20%
	Klasse I2	1.20%
	Klasse I2 EUR H	1.20%
	Klasse IT	1.20%
	Klasse N2	2.30%
	Klasse NT	2.30%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.85%
US High Yield Portfolio	Klasse A2	1.55%
	Klasse A2 EUR H	1.55%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
US High Yield Portfolio	Klasse AT(d)	1.55%
	Klasse C2	2.00%
	Klasse I2	1.00%
	Klasse I2 EUR H	1.00%
	Klasse N2	2.10%
	Klasse NT	2.10%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse ZT	0.01%
Low Volatility Equity Portfolio	Klasse A	1.90%
	Klasse A AUD H	1.90%
	Klasse A EUR	1.90%
	Klasse A EUR H	1.90%
	Klasse A NZD H	1.90%
	Klasse A PLN H	1.90%
	Klasse A SGD H	1.90%
	Klasse AD	1.90%
	Klasse AD AUD H	1.90%
	Klasse AD CAD H	1.90%
	Klasse AD EUR H	1.90%
	Klasse AD GBP H	1.90%
	Klasse AD NZD H	1.90%
	Klasse AD RMB H	1.90%
	Klasse AD SGD H	1.90%
	Klasse AD ZAR H	1.90%
	Klasse AR	1.90%
	Klasse AR EUR H	1.90%
	Klasse C	2.35%
	Klasse ED	2.90%
	Klasse ED AUD H	2.90%
	Klasse ED ZAR H	2.90%
	Klasse I	1.10%
	Klasse I EUR	1.10%
	Klasse I EUR H	1.10%
	Klasse I GBP	1.10%
	Klasse I GBP H	1.10%
	Klasse I SGD H	1.10%
	Klasse N	2.35%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 EUR	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1D	0.65%
	Klasse SD	0.15%
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	Klasse A	1.95%
	Klasse AD	1.95%
	Klasse AD AUD H	1.95%
	Klasse AD CAD H	1.95%
	Klasse AD EUR H	1.95%
	Klasse AD GBP H	1.95%
	Klasse AD NZD H	1.95%
	Klasse AD SGD H	1.95%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	Klasse F	0.575%
	Klasse F EUR H	0.575%
	Klasse I	1.15%
	Klasse I GBP H	1.15%
	Klasse I SGD H	1.15%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR	0.15%
	Klasse S GBP	0.15%
	Klasse S1	1.00%
Global Dynamic Bond Portfolio	Klasse A2 CHF H(e)	1.25%
	Klasse A2 EUR H(e)	1.25%
	Klasse A2 SGD H(e)	1.25%
	Klasse A2 USD H(e)	1.25%
	Klasse AR EUR H(e)	1.25%
	Klasse I2(f)	0.70%
	Klasse I2 CHF H(f)	0.70%
	Klasse I2 EUR H(f)	0.70%
	Klasse I2 USD H(f)	0.70%
Global Equity Income Portfolio(g)	Klasse A	1.80%
	Klasse A EUR H	1.80%
	Klasse A SGD H	1.80%
	Klasse AD	1.80%
	Klasse AD SGD H	1.80%
	Klasse C	2.25%
	Klasse C EUR H	2.25%
	Klasse CD	2.25%
	Klasse I	1.00%
	Klasse I CHF H	1.00%
	Klasse I EUR H	1.00%
	Klasse I GBP H	1.00%
	Klasse N	2.25%
	Klasse ND	2.25%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	1.00%
	Klasse S1 GBP	1.00%
Concentrated US Equity Portfolio	Klasse A(h)	1.79%
	Klasse A AUD H(h)	1.79%
	Klasse A EUR (h)	1.79%
	Klasse A EUR H(h)	1.79%
	Klasse A SGD H(h)	1.79%
	Klasse AR EUR(h)	1.79%
	Klasse C	2.30%
	Klasse I(i)	0.94%
	Klasse I AUD H(i)	0.94%
	Klasse I CHF H(i)	0.94%
	Klasse I EUR H(i)	0.94%
	Klasse I GBP(i)	0.94%
	Klasse I GBP H(i)	0.94%
	Klasse I SGD H(i)	0.94%
	Klasse N	2.30%
	Klasse S	0.15%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Concentrated US Equity Portfolio	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S1	0.90%
	Klasse S1 EUR H	0.90%
	Klasse S1 GBP H	0.90%
	Klasse SD	0.15%
Concentrated Global Equity Portfolio	Klasse A(j)	1.89%
	Klasse A EUR H(j)	1.89%
	Klasse A SGD H(j)	1.89%
	Klasse AR EUR(j)	1.89%
	Klasse C	2.45%
	Klasse I(k)	0.99%
	Klasse I CAD H(k)	0.99%
	Klasse I CHF H(k)	0.99%
	Klasse I EUR(k)	0.99%
	Klasse I EUR H(k)	0.99%
	Klasse I GBP(k)	0.99%
	Klasse I GBP H(k)	0.99%
	Klasse N	2.45%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S GBP	0.15%
	Klasse S1	1.00%
	Klasse S1 EUR H	1.00%
Global Core Equity Portfolio	Klasse A	1.90%
	Klasse A AUD H	1.90%
	Klasse A EUR H	1.90%
	Klasse A SGD H	1.90%
	Klasse AR EUR	1.90%
	Klasse C	2.35%
	Klasse I	1.10%
	Klasse I AUD H	1.10%
	Klasse I CHF H	1.10%
	Klasse I EUR	1.10%
	Klasse I EUR H	1.10%
	Klasse I GBP H	1.10%
	Klasse I SGD H	1.10%
	Klasse IX EUR	0.80%
	Klasse N	2.35%
	Klasse RX EUR	1.99%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse S NOK HP	0.15%
	Klasse S1	0.75%
	Klasse S1 EUR H	0.75%
	Klasse S1 NOK HP	0.75%
	Klasse S1X EUR(l)	0.425%
	Klasse SD	0.15%
	Klasse XX EUR(m)	0.65%
	Klasse XX GBP(n)	0.65%
Global Income Portfolio	Klasse A2	1.40%
	Klasse A2 AUD H	1.40%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Global Income Portfolio	Klasse A2 CAD H	1.40%
	Klasse A2 CHF H	1.40%
	Klasse A2 EUR H	1.40%
	Klasse A2 GBP H	1.40%
	Klasse A2 PLN H	1.40%
	Klasse A2 SGD H	1.40%
	Klasse AA	1.40%
	Klasse AA AUD H	1.40%
	Klasse AA CAD H	1.40%
	Klasse AA EUR H	1.40%
	Klasse AA SGD H	1.40%
	Klasse AT	1.40%
	Klasse AT AUD H	1.40%
	Klasse AT CAD H	1.40%
	Klasse AT EUR H	1.40%
	Klasse AT GBP H	1.40%
	Klasse AT SGD H	1.40%
	Klasse I2	0.85%
	Klasse I2 AUD H	0.85%
	Klasse I2 CAD H	0.85%
	Klasse I2 CHF H	0.85%
	Klasse I2 EUR H	0.85%
	Klasse I2 GBP H	0.85%
	Klasse I2 SGD H	0.85%
	Klasse IT	0.85%
	Klasse IT AUD H	0.85%
	Klasse IT CAD H	0.85%
	Klasse IT EUR H	0.85%
	Klasse IT SGD H	0.85%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1 GBP H	0.65%
Alternative Risk Premia Portfolio	Klasse F	0.60%
	Klasse F EUR H	0.60%
	Klasse F GBP H	0.60%
	Klasse I	0.95%
	Klasse I EUR H	0.95%
	Klasse I GBP H	0.95%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.85%
	Klasse S1 EUR H	0.85%
	Klasse S1 GBP H	0.85%
	Klasse S1QD(o)	0.35%
	Klasse S1QD EUR H(o)	0.35%
	Klasse S3 AUD H	0.15%
European Equity Portfolio	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.75%
	Klasse S1 GBP	0.75%
	Klasse S1NN	0.75%
	Klasse S1X	0.70%
	Klasse SD	0.15%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Eurozone Equity Portfolio . . .	Klasse A	1.95%
	Klasse A AUD H	1.95%
	Klasse A PLN H	1.95%
	Klasse A SGD H	1.95%
	Klasse A USD H	1.95%
	Klasse AR	1.95%
	Klasse AX	1.90%
	Klasse BX	2.90%
	Klasse C	2.40%
	Klasse C USD H	2.40%
	Klasse CX	2.35%
	Klasse I	1.15%
	Klasse I GBP	1.15%
	Klasse I USD H	1.15%
	Klasse INN	1.15%
	Klasse IX	1.10%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.80%
	Klasse S1 GBP	0.80%
	Klasse S1 USD H	0.80%
	Klasse S1N	0.70%
	Klasse S1N USD	0.70%
American Growth Portfolio . .	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S1	0.80%
	Klasse S1 EUR H	0.80%
	Klasse SD	0.15%
	Klasse SK	0.85%
All Market Income Portfolio	Klasse A	1.85%
	Klasse A CHF H	1.85%
	Klasse A EUR H	1.85%
	Klasse A HKD	1.85%
	Klasse A SGD H	1.85%
	Klasse A2X	1.65%
	Klasse AD	1.85%
	Klasse AD AUD H	1.85%
	Klasse AD CAD H	1.85%
	Klasse AD EUR H	1.85%
	Klasse AD GBP H	1.85%
	Klasse AD HKD	1.85%
	Klasse AD NZD H	1.85%
	Klasse AD RMB H	1.85%
	Klasse AD SGD H	1.85%
	Klasse AD ZAR H	1.85%
	Klasse AMG	1.85%
	Klasse AMG EUR H	1.85%
	Klasse ANN	1.85%
	Klasse ANN EUR H	1.85%
	Klasse AQG	1.85%
	Klasse AQG EUR H	1.85%
	Klasse AR EUR H	1.85%
	Klasse AX	1.65%
	Klasse B	2.85%
	Klasse B2X	2.65%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
All Market Income Portfolio	Klasse BX	2.65%
	Klasse C	2.30%
	Klasse C2X	2.10%
	Klasse CD	2.30%
	Klasse CX	2.10%
	Klasse ED	2.85%
	Klasse ED AUD H	2.85%
	Klasse ED ZAR H	2.85%
	Klasse I	1.05%
	Klasse I CHF H	1.05%
	Klasse I EUR H	1.05%
	Klasse I SGD H	1.05%
	Klasse ID	1.05%
	Klasse IMG	1.05%
	Klasse IMG EUR H	1.05%
	Klasse INN	1.05%
	Klasse INN EUR H	1.05%
	Klasse INN GBP H	1.05%
	Klasse IQG	1.05%
	Klasse IQG EUR H	1.05%
	Klasse N	2.30%
	Klasse ND	2.30%
	Klasse S1	0.85%
	Klasse S1 CHF H	0.85%
	Klasse S1 EUR H	0.85%
	Klasse S1 GBP H	0.85%
	Klasse S1D JPY H	0.85%
	Klasse S1QG GBP H	0.85%
China A Shares Equity Portfolio	Klasse A	1.99%
	Klasse A AUD H	1.99%
	Klasse A CAD H	1.99%
	Klasse A EUR	1.99%
	Klasse A HKD H	1.99%
	Klasse A NZD H	1.99%
	Klasse A SGD H	1.99%
	Klasse A USD	1.99%
	Klasse A USD H	1.99%
	Klasse AD HKD	1.99%
	Klasse AD HKD H	1.99%
	Klasse AD SGD H	1.99%
	Klasse AD USD H	1.99%
	Klasse I	1.19%
	Klasse I GBP	1.19%
	Klasse I USD H	1.19%
	Klasse S	0.20%
	Klasse S USD	0.20%
	Klasse S1	0.95%
	Klasse S1 EUR	0.95%
	Klasse SP1 USD	0.20%
Financial Credit Portfolio . . .	Klasse A2	1.40%
	Klasse A2 CHF H	1.40%
	Klasse A2 EUR H	1.40%
	Klasse AT	1.40%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Financial Credit Portfolio . . .	Klasse I2	0.85%
	Klasse I2 CHF H	0.85%
	Klasse I2 EUR H	0.85%
	Klasse I2 GBP H	0.85%
	Klasse IT	0.85%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1 GBP H	0.65%
	Klasse ZT	0.01%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio.	Klasse A2	1.08%
	Klasse I2	0.63%
	Klasse I2 GBP H	0.63%
	Klasse I2 USD H	0.63%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.55%
	Klasse S1 GBP H	0.55%
	Klasse S1 USD H	0.55%

(a) Die Anteilklasse wurde am 20. Juni 2019 aufgelöst.
(b) Die Anteilklasse wurde am 29. November 2019 aufgelöst.
(c) Die Anteilklasse wurde am 26. August 2019 aufgelöst.
(d) Die Anteilklasse wurde am 17. März 2020 aufgelöst.
(e) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 29. Mai 2020 von 1.45% auf 1.25% gesenkt.
(f) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 29. Mai 2020 von 0.90% auf 0.70% gesenkt.
(g) Der letzte Nettoinventarwert wurde am 9. Dezember 2019 berechnet.
(h) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 29. Mai 2020 von 1.85% auf 1.79% gesenkt.
(i) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 29. Mai 2020 von 1.05% auf 0.94% gesenkt.
(j) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 29. Mai 2020 von 2.00% auf 1.89% gesenkt.
(k) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 29. Mai 2020 von 1.20% auf 0.99% gesenkt.
(l) Die Anteilklasse wurde am 5. März 2020 aufgelöst.
(m) Die Anteilklasse wurde am 13. März 2020 aufgelöst.
(n) Die Anteilklasse wurde am 3. Juli 2019 aufgelöst.
(o) Die Anteilklasse wurde am 27. Mai 2020 aufgelöst.

Folgende Tabelle gibt Aufschluss über die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen während des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2020 und die Forderungen aus Aufwandserstattungen zum 31. Mai 2020:

AB SICAV I–	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwandserstattungen
Global Real Estate Securities Portfolio	$ 28,554	5,882
Sustainable Global Thematic Portfolio	$ –	6,550
Euro High Yield Portfolio	€ 64,862	29,073
US Small and Mid-Cap Portfolio	$ 55,298	55,282
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	$ –	190
RMB Income Plus Portfolio	CNH 3	3
Select US Equity Portfolio.	$ 100,204	26,940
Global Plus Fixed Income Portfolio	$ 92,446	12,928
Select Absolute Alpha Portfolio. . .	$ 15,564	–
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	$ 287,312	18,302
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio.	$ 110,409	5,120
Emerging Market Corporate Debt Portfolio.	$ 55,352	7,662
US High Yield Portfolio.	$ 165,812	23,955
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	$ 199,965	21,495
Global Dynamic Bond Portfolio	£ 142,891	–
Global Equity Income Portfolio (a)	$ 63,200	–
Concentrated US Equity Portfolio	$ 311	197
Concentrated Global Equity Portfolio	$ 9	–
Global Core Equity Portfolio	$ 9,365	–
Global Income Portfolio	$ 86,312	18,016
Alternative Risk Premia Portfolio	$ 169,350	3,836
Eurozone Equity Portfolio	€ –	52
All Market Income Portfolio	$ 4,897	4,897
China A Shares Equity Portfolio	CNH 1,139,634	288,920
Financial Credit Portfolio	$ 132,721	23,891
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio.	€ 72,109	13,418

(a) Der letzte Nettoinventarwert wurde am 9. Dezember 2019 (Schließungsdatum) berechnet.

Die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen sind in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erstattete oder erlassene Aufwendungen“ enthalten. Die Forderungen aus Aufwandserstattungen sind in der Zusammensetzung des Fondsvermögens unter „Sonstige Forderungen“ bzw. unter „Aufgelaufene Aufwendungen und andere Verbindlichkeiten“ enthalten.

Der Fonds zahlt seiner Verwaltungsgesellschaft außerdem eine Verwaltungsgesellschaftsgebühr. Bestimmte Anteilklassen jedes Portefeuilles entrichten an die Hauptvertriebsstelle eine Vertriebsgebühr als Entlohnung für Dienstleistungen, die dem Fonds im Zusammenhang mit dem Vertrieb dieser Anteilklassen erbracht werden.

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

Die Jahressätze der betreffenden Gebühren für die einzelnen Portefeuilles sind in Tabelle 1 (auf Seite 326 bis 344) aufgeführt. Ferner unterliegen die Anteile der Klassen B, BD, BXX und die entsprechenden Anteile der Klasse H einem Rücknahmeabschlag in Höhe von zwischen 0.00% und 3.00% bzw. zwischen 0.00% und 4.00%. Die Anteile der Klassen B2, B2X, BT, E, ED und die entsprechenden Anteile der Klasse H unterliegen einem Rücknahmeabschlag in Höhe von zwischen 0.00% und 3.00%. Die Klassen C, C2, CD, CT, C2X, CX und die entsprechenden Anteile der Klasse H unterliegen einem Rücknahmeabschlag zu einem Satz von zwischen 0.00% und 1.00%. Der Händler kann unter bestimmten Umständen auf diese Gebühr verzichten.

Der Fonds zahlt seiner Registrier- und Transferstelle AllianceBernstein Investor Services, einem Geschäftsbereich der Verwaltungsgesellschaft, gemäß einem Verwaltungsfonds-Dienstvertrag eine Vergütung dafür, dass sie Personal und Räumlichkeiten im Rahmen der Erbringung von Dienstleistungen als Registrier- und Transferstelle des Fonds zur Verfügung stellt. Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 belief sich diese Vergütung auf $9,029,363.

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 das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 belief sich diese Vergütung auf $1,447,628. Der Betrag ist in der „Gebühr für professionelle Dienstleistungen“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten.

Der Fonds vergütet seinen Rechtsberater Elvinger, Hoss Prussen, *société anonyme* (bei der Yves Prussen, Verwaltungsratsmitglied des Fonds bis zum 13. Januar 2020 und Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft des Fonds, Partner ist) für juristische Dienstleistungen, die gegenüber dem Fonds erbracht werden. Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 wurden Zahlungen in Höhe von €33,393 geleistet, die unter „Gebühr für professionelle Dienstleistungen“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten sind.

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

Alle im Namen des Fonds abgeschlossenen Geschäfte wurden im Verlauf der regulären Geschäftstätigkeit und/oder zu den handelsüblichen Bedingungen getätigt.

Der Gesamtwert der vom Fonds über die verbundenen Unternehmen Sanford C. Bernstein & Co., LLC und Sanford C. Bernstein Ltd. durchgeführten Transaktionen belief sich auf $39,855. Dies entspricht einem Prozentsatz von weniger als 0.01% aller Transaktionen. Es wurde eine Provision in Höhe von $1 für den Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 für Wertpapiertransaktionen unter Beanspruchung der Dienste der verbundenen Unternehmen 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 Global Plus Fixed Income Portfolio, das US High Yield Portfolio und das Global Income Portfolio investieren in das AB FCP I – Mortgage Income Portfolio, ein von der Verwaltungsgesellschaft verwaltetes Portefeuille.

ANMERKUNG F: Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen

Im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 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 der Grundlage 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, darunter der Umfang und die Art der Brokergebühren.

Darüber hinaus können aufgrund der Art der Anlagestrategie bestimmter Portefeuilles, einschließlich der Fälle, in denen der Anlageverwalter Anlageverwaltungsdienstleistungen an AllianceBernstein Limited und CPH Capital Fondsmæglerselskab A/S delegiert, alle Kosten im Zusammenhang mit Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen „entflochten“ und vom Anlageverwalter oder seinen Unterbeauftragten 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 Anlagediensten 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, Angestelltengehälter oder direkte geldliche Zahlungen.

Transaktionskosten sind Kosten, die beim Kauf, bei der Emission oder beim Verkauf 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 zählen keine Schuldenauf- oder -abschläge, Finanzierungskosten oder internen Verwaltungs- oder Bestandskosten. Transaktionskosten sind in den Anlagekosten im Anlageportfolio sowie in „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen“ und „Veränderung der nicht realisierten Wertsteigerung und (Wertminderung) aus Anlagen“ in der Aufwands- und Ertragsrechnung und Entwicklung des Nettovermögens enthalten. Die Transaktionskosten werden in der Berechnung der Gesamtkostenquote und/oder der Aufwandserstattung nicht berücksichtigt.

In der folgenden Tabelle sind die Transaktionskosten, die den einzelnen Portefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 entstanden sind, aufgeführt:

AB SICAV I–		Transaktionskosten
International Health Care Portfolio	$	326,365
International Technology Portfolio	$	333,491
Global Real Estate Securities Portfolio	$	57,309
Sustainable Global Thematic Portfolio	$	436,864
India Growth Portfolio	$	447,773
Euro High Yield Portfolio	€	3,709
US Small and Mid-Cap Portfolio	$	47,146
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	$	5,242,748
RMB Income Plus Portfolio	CNH	21,991
Short Duration High Yield Portfolio	$	22,993
Select US Equity Portfolio	$	2,685,909
Global Plus Fixed Income Portfolio	$	152,157
Select Absolute Alpha Portfolio	$	433,621
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	$	380,420
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	$	67,445
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	$	42,371
US High Yield Portfolio	$	2,433
Low Volatility Equity Portfolio	$	3,076,294
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	$	2,501,426
Global Dynamic Bond Portfolio	£	213,943
Global Equity Income Portfolio (a)	$	3,896
Concentrated US Equity Portfolio	$	128,260
Concentrated Global Equity Portfolio	$	264,680
Global Core Equity Portfolio	$	1,423,308
Global Income Portfolio	$	29,636
Alternative Risk Premia Portfolio	$	298,272
European Equity Portfolio	€	853,700
Eurozone Equity Portfolio	€	1,721,380
American Growth Portfolio	$	316,449
All Market Income Portfolio	$	1,008,516
China A Shares Equity Portfolio	CNH	3,079,457
Financial Credit Portfolio	$	-0-
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	€	437

(a) Der letzte Nettoinventarwert wurde am 9. Dezember 2019 (Schließungsdatum) berechnet.

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 Vermögensaufstellung 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 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 und der 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 zwischen den verschiedenen Anteilklassen eines Portefeuilles keine getrennte Haftung existiert, besteht ein geringes Risiko, dass unter bestimmten Umständen Währungsabsicherungsgeschäfte in Bezug auf eine währungsabgesicherte Anteilklasse zu Verbindlichkeiten führen könnten, die den NIW der anderen Anteilklassen desselben Portefeuilles beeinträchtigen könnten. In diesem Fall können die Vermögenswerte der anderen Anteilklassen des betreffenden Portefeuilles zur Abdeckung der Verluste der währungsabgesicherten Anteilklasse herangezogen werden. Die Wertpapiere des Fonds dienen als Sicherheiten für Devisenterminkontrakte, einschließlich solcher, die zur Absicherung auf Anteilklassenebene verwendet werden.

ANMERKUNG H: 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. Diese erhaltenen bzw. geleisteten Zahlungen werden als Einschusszahlung bezeichnet und vom Fonds als unrealisierte Gewinne bzw. Verluste 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 I: Swap-Geschäfte
Ein Swap ist eine Vereinbarung, die zwei Parteien dazu verpflichtet, in bestimmten Zeitabständen eine Reihe von Geldflüssen auszutauschen. Diese beruhen auf bzw. berechnen sich auf der Grundlage von Veränderungen bestimmter Preise oder Zinssätze für einen bestimmten Betrag eines Basiswerts oder eines anderweitig festgelegten Nominalbetrags. 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 als Komponente der „Veränderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ ausgewiesen.

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 bilaterale 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 bilaterale 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 verpflichtet sich der „Käufer“ zu regelmäßigen Zahlungen an den „Verkäufer“ während der Laufzeit des Kontrakts. Im Gegenzug erhält der Käufer bei Eintritt eines Kreditereignisses beim zugrunde liegenden Referenzschuldner eine Ausgleichszahlung.

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.

Varianz-Swaps
Varianz-Swaps sind Kontrakte, bei denen zwei Parteien vereinbaren, auf Basis der Differenz zwischen dem angegebenen Varianzniveau und der Varianz, die auf einen oder mehrere zugrunde liegende Vermögenswerte oder Indizes tatsächlich realisiert wurde, Barzahlungen auszutauschen. Die tatsächliche „Varianz“, wie sie hier verwendet wird, ist definiert als die Summe des Quadrats der Renditen des/der Referenzvermögenswerte bzw. des Index/der Indizes (die faktisch ein Maß für die „Volatilität“ darstellt) über die Dauer der Vertragslaufzeit. Die beiden Parteien eines Varianz-Swaps tauschen also sozusagen die tatsächliche Volatilität gegen eine vertraglich festgelegte Volatilitätsrate aus.

ANMERKUNG J: 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 Ausleihung zahlen.

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

Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 erwirtschafteten die Portfolios einen Netto-Gebührentrag, der in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus Wertpapierleihgeschäften, netto“ ausgewiesen ist.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 verdiente Brothers Harriman & Co. (in ihrer Funktion als Wertpapierleihagent) ein Honorar von $504,134 für die Bereitstellung von Wertpapierleihdiensten. Dieses Honorar ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe“ ausgewiesen.

Die zum 31. Mai 2020 verliehenen Wertpapiere und die entsprechenden ausstehenden Sicherheiten haben folgenden Wert. Die Sicherheiten beziehen sich auf die in den Portefeuilles gehaltenen Wertpapiere.

AB SICAV I–		Wert	Marktwert der Sicherheiten
International Technology Portfolio			
Citigroup Global Markets Limited	$	9,191,605	9,651,186
UBS AG	$	6,932,685	12,221,155
Global Real Estate Securities Portfolio			
Merrill Lynch	$	147,598	154,978
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio			
JPMorgan Chase	$	2,549,558	2,677,037
Citigroup Global Markets Limited	$	193,281	202,946
Merrill Lynch	$	6,141	6,448
Low Volatility Equity Portfolio			
Merrill Lynch	$	28,073,970	29,477,670
Morgan Stanley	$	416,520	508,062
Concentrated Global Equity Portfolio			
Morgan Stanley	$	10,225,531	12,472,877
UBS AG	$	4,737,296	8,351,056
Citigroup Global Markets Limited	$	1,298,666	1,363,600
Merrill Lynch	$	502,661	527,794
Alternative Risk Premia Portfolio			
Citigroup Global Markets Limited	$	713,251	1,302,827
UBS AG	$	622,978	1,098,204
Merrill Lynch	$	107,747	361,079
European Equity Portfolio			
Societe Generale	€	6,851,547	7,194,123
Credit Suisse	€	6,235,780	6,547,574
Eurozone Equity Portfolio			
Societe Generale	€	34,098,669	36,700,187
Citigroup Global Markets Limited	€	20,090,028	21,094,529

ANMERKUNG K: 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 L: Optionsgeschäfte

Der Fonds kann Kauf- und Verkaufsoptionen auf Wertpapiere kaufen und verkaufen. Das mit dem Kauf einer Option verbundene 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 Gesamtrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Eine Payer Swaption gibt dem Erwerber das Recht auf Zahlung der Gesamtrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Swaptions enthalten ferner Optionen, die es ermöglichen, ein bestehendes Swap-Geschäft durch einen der Kontrahenten zu beenden oder zu verlängern.

ANMERKUNG M: Sicherheiten

In der folgenden Tabelle sind die Barsicherheiten aufgeführt, die von Brokern für bestimmte Finanzderivate zum 31. Mai 2020 gehalten oder die diesen dafür geschuldet wurden:

AB SICAV I–		Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker geschuldete Barmittel
Sustainable Global Thematic Portfolio			
Barclays	$	248,127	–
Citibank	$	272,657	–
Morgan Stanley	$	239,636	–
Euro High Yield Portfolio			
Citibank	€	650,728	1,825
Goldman Sachs	€	576,579	215,313
JPMorgan Chase	€	–	511,000
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio			
Bank of America	$	310,000	–
Barclays	$	500,000	–
Goldman Sachs	$	61,126,594	66,302,023
JPMorgan Chase	$	–	1,891,409
Morgan Stanley	$	6,605,223	6,982,156
RBS – Natwest Markets	$	24,000	–
UBS AG	$	2,831,000	–
RMB Income Plus Portfolio			
Citibank	CNH	6,076,937	2
Morgan Stanley	CNH	3,908,017	2,012,983
Short Duration High Yield Portfolio			
Barclays	$	2,400,000	–
Citibank	$	1,482,967	–
Credit Suisse	$	–	1,120,000
Deutsche Bank	$	1,880,000	–
Goldman Sachs	$	4,960,000	–
JPMorgan Chase	$	–	9,222,550
Morgan Stanley	$	11,061,078	746,044
Global Plus Fixed Income Portfolio			
Citibank	$	1,136,149	531,035
Credit Suisse	$	4,460,000	–
Goldman Sachs	$	1,592,132	3,200,324
Morgan Stanley	$	420,000	–
Select Absolute Alpha Portfolio			
Morgan Stanley	$	430,296	–
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio			
Barclays	$	180,000	–
BNP Paribas	$	–	120,000
Citibank	$	140	–
Goldman Sachs	$	380,000	–
JPMorgan Chase	$	260,000	–
Morgan Stanley	$	2,017,162	1,602,579
RBS – Natwest Markets	$	284,000	–
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio			
Citibank	$	92,511	–
Goldman Sachs	$	435,637	414,012
Emerging Market Corporate Debt Portfolio			
Citibank	$	275,994	38,330
US High Yield Portfolio			
Citibank	$	111,295	–
Morgan Stanley	$	2,870,818	147,045
Low Volatility Equity Portfolio			
JPMorgan Chase	$	–	1,163,122
Global Dynamic Bond Portfolio			
Citibank	£	3,658,504	3,824,426
Credit Suisse	£	2,777,328	–
Goldman Sachs	£	204	477,733
Morgan Stanley	£	560,487	1,538
Global Income Portfolio			
Citibank	$	1,646,884	24,002
Goldman Sachs	$	700,000	–
Morgan Stanley	$	637,149	80,172
Alternative Risk Premia Portfolio			
Credit Suisse	$	–	7,000
Goldman Sachs	$	2,081,528	1,278,582
Morgan Stanley	$	7,143,304	3,730,884
European Equity Portfolio			
Goldman Sachs	€	17,855	–
Eurozone Equity Portfolio			
Goldman Sachs	€	90,593	–
All Market Income Portfolio			
Bank of America	$	355,000	–
Citibank	$	9,985,027	26
Morgan Stanley	$	29,096,629	11,888,093
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio			
Citibank	€	40,708	22,347

Barsicherheiten, die von Brokern in Bezug auf Derivate gehalten bzw. diesen geschuldet werden, sind in der Vermögensaufstellung unter „Barmittel bei Verwahrstelle und Broker“ und „Verbindlichkeiten gegenüber Verwahrstelle und Broker“ ausgewiesen.

In Bezug auf die am 31. Mai 2020 von den einzelnen Portfolios gehaltenen Derivate sind in der folgenden Tabelle aus Wertpapieren bestehende Sicherheiten aufgeführt:

AB SICAV I–	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
Global Plus Fixed Income Portfolio		
Bank of America		
U.S. Treasury Note, 2.00%, 08/15/2025	$ –	204,039
Citigroup		
U.S. Treasury Inflation Index, 0.13%, 07/15/2024	$ 478,759	–
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Bond, 4.50%, 02/15/2036	$ 1,390,556	–
U.S. Treasury Bond, 4.50%, 08/15/2039	$ 4,979,748	–
JP Morgan Chase		
U.S. Treasury Bond, 3.00%, 02/15/2048	$ 298,351	–
U.S. Treasury Bond, 4.50%, 08/15/2039	$ 357,835	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bond, 4.50%, 08/15/2039	$ 346,528	–
Standard Chatered		
U.S. Treasury Bond, 4.50%, 02/15/2036	$ 308,127	–
Select Absolute Alpha Portfolio		
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bill, 0.00%, 07/16/2020	$ 2,799,545	–
U.S. Treasury Note, 2.50%, 01/31/2024	$ –	230,281
US High Yield Portfolio		
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Note, 1.50%, 09/30/2024	$ 300,473	–
Global Dynamic Bond Portfolio		
Bank of America		
U.S. Treasury Note, 2.13%, 09/30/2021	£ –	368,727
Barclays		
U.S. Treasury Inflation Index, 0.63%, 01/15/2026	£ 217,471	–
Global Dynamic Bond Portfolio		
Citigroup		
U.S. Treasury Inflation Index, 0.63%, 01/15/2024	£ 1,675,798	–
U.S. Treasury Inflation Index, 0.63%, 01/15/2026	£ 4,816,629	–
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Inflation Index, 0.63%, 01/15/2024	£ 1,174,368	–
JPMorgan Chase		
U.S. Treasury Inflation Index, 0.63%, 01/15/2024	£ 1,966,957	–
Global Income Portfolio		
Citigroup		
U.S. Treasury Bond, 6.00%, 02/15/2026	$ 995,743	–
Deutsche Bank		
U.S. Treasury Bond, 6.75%, 08/15/2026	$ 596,759	–
JPMorgan Chase		
U.S. Treasury Bond, 6.75%, 08/15/2026	$ 84,657	–
U.S. Treasury Note, 1.63%, 08/15/2029	$ 261,501	–
Alternative Risk Premia Portfolio		
Bank of America		
U.S. Treasury Bill, 0.00%, 06/11/2020	$ 690,976	–
Barclays		
U.S. Treasury Bill, 0.00%, 12/03/2020	$ –	282,368
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Bill, 0.00%, 06/11/2020	$ 4,999,827	–
JPMorgan Chase		
U.S. Treasury Bill, 0.00%, 10/22/2020	$ 1,528,897	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bill, 0.00%, 06/11/2020	$ 651,077	–
All Market Income Portfolio		
Citigroup		
U.S. Treasury Note, 1.63%, 08/15/2029	$ 813,425	–
U.S. Treasury Note, 2.63%, 02/15/2029	$ 2,379,180	–
Credit Suisse		
U.S. Treasury Note, 1.63%, 08/15/2029	$ 908,050	–
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Note, 1.63%, 08/15/2029	$ 5,438,805	–
JPMorgan Chase		
U.S. Treasury Note, 1.63%, 08/15/2029	$ 6,819,870	–
U.S. Treasury Note, 2.50%, 12/31/2020	$ 948,273	–
U.S. Treasury Note, 2.63%, 02/15/2029	$ 4,309,462	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Note, 2.50%, 02/28/2021	$ 2,688,325	–

AB SICAV I–	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
UBS AG		
U.S. Treasury Note, 1.63%, 08/15/2029	$ 1,261,447	–

ANMERKUNG N: 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 Anteilinhaber 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 zu Pools zusammengefasst werden, werden die Vermögenswerte, die jedem einzelnen beteiligten Portefeuille zuzurechnen sind, anfänglich unter Bezugnahme auf die ursprüngliche Vermögenswertzuweisung an den Pool festgelegt und dann auf Grundlage weiterer Zuweisungen bzw. Entnahmen geändert.

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 31. Mai 2020 verwaltet der Fonds die Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb des Fonds unter Verwendung der folgenden Pools gemeinsam:

Pool an Vermögenswerten	Beteiligte Portefeuilles
AB — Global Growth Pool	Sustainable Global Thematic Portfolio

ANMERKUNG O: Clearing-Reserve

(Die folgenden Angaben gelten für das China A Shares Equity Portfolio)

Gemäß den Anlageverordnungen ist die Unterverwahrstelle verpflichtet, eine Clearing-Mindestreserve als Prozentsatz der ABL-Quote zu hinterlegen. Der Prozentsatz wird jeweils von den Niederlassungen der China Securities Depository & Clearing Corporation Limited („CSDCC") in Shanghai und Shenzhen festgelegt. Derzeit beträgt die Clearing-Mindestreserve, die von den Niederlassungen der CSDCC in Shanghai und Shenzhen festgelegt wurde, 0.08% bzw. 0.06%.

ANMERKUNG P: Leistungsgebühr

Select US Equity Portfolio

Der Anlageverwalter erhält vom Portefeuille, in der Regel am Ende eines jeden Geschäftsjahres, einen Betrag in Höhe von 25% des Betrags, um den der NIW jedes der relevanten Anteile des Portefeuilles am Ende dieses Geschäftsjahres (vor Abzug der Leistungsgebühr für das laufende Geschäftsjahr und nach Abzug der Managementgebühr) (der „bereinigte NIW") die Performance des S&P 500 Index (der „Index") während dieses Geschäftsjahres übersteigt. Vorsorglich und vorbehaltlich dieses Abschnitts wird darauf hingewiesen, dass die Leistungsgebühr unabhängig davon gezahlt wird, ob der Index selbst für das jeweilige Geschäftsjahr eine positive oder negative Performance aufweist. Ausschüttungen an Anteilinhaber während eines solchen Geschäftsjahres werden wieder zum bereinigten NIW hinzuaddiert.

Die Indexperformance im Hinblick auf ein Geschäftsjahr wird als die Differenz zwischen dem am Bewertungszeitpunkt am letzten Geschäftstag des vorherigen Geschäftsjahres des Portefeuilles berechneten Niveaus des Index und dem am Bewertungszeitpunkt des letzten Geschäftstages des aktuellen Geschäftsjahres des Portefeuilles berechneten Niveaus des Index berechnet und als Prozentsatz ausgedrückt.

Die Portefeuille-Performance im Hinblick auf ein Geschäftsjahr wird als die Differenz zwischen dem bereinigten Eröffnungs-NIW am letzten Geschäftstag des vorherigen Geschäftsjahres des Portefeuilles und dem bereinigten NIW am Bewertungszeitpunkt am letzten Geschäftstag des aktuellen Geschäftsjahres des Portefeuilles berechnet und als Prozentsatz ausgedrückt.

Die Berechnung der Leistungsgebühr basiert auf dem „gewichteten Durchschnitt" der in Umlauf befindlichen Anteile während des Geschäftsjahres des Portefeuilles, solange der gewichtete Durchschnitt der Anteile die aktuell im Umlauf befindlichen Anteile nicht um mehr als 20% übersteigt. In Fällen, in denen der gewichtete Durchschnitt der Anteile die aktuell im Umlauf befindlichen Anteile um mehr als 20% übersteigt, wird die Leistungsgebühr auf der Grundlage der aktuell im Umlauf befindlichen Anteile berechnet. Der „gewichtete Durchschnitt der Anteile" ist die Summe der ausgegebenen Anteile an jedem Kalendertag des Geschäftsjahres des Portefeuilles, einschließlich der Wochenenden, dividiert durch die Gesamtzahl der Tage in diesem Geschäftsjahr.

Bei der Berechnung der Leistungsgebühr für Anteile der Klasse H wird die Verwaltungsgesellschaft die Auswirkungen von Währungsabsicherungsaktivitäten nicht berücksichtigen. Die Wechselkurse, die zur Berechnung des NIW (einschließlich

der bereinigten NIWs) für abgesicherte Anteilklassen genutzt werden, sind die vorherrschenden Wechselkurse am Bewertungszeitpunkt des Fonds. Daher kann eine Leistungsgebühr für Anteile der Klasse H nach den Auswirkungen der Währungsabsicherung abgegrenzt und gezahlt werden.

Die eventuell anfallende Leistungsgebühr ist jährlich nach dem Ende eines jeden Geschäftsjahres zahlbar. Leistungsgebühren werden von der Verwaltungsstelle berechnet und von der Verwahrstelle überprüft. Die Berechnungen der Leistungsgebühr werden zudem von den Abschlussprüfern im Rahmen der jährlichen Abschlussprüfung des Fonds überprüft.

Falls die Anteilklasse des Portefeuilles, für die eine Leistungsgebühr erhoben wird, zu einem anderen Zeitpunkt als zum Ende eines Geschäftsjahres zurückgenommen wird, wird eine Leistungsgebühr in Bezug auf diese Anteile für den betreffenden Teil des Geschäftsjahres ermittelt und zu dem entsprechenden Datum gezahlt.

Leistungsgebühren sind auf den bereinigten NIW (der nicht realisierte Nettogewinne und -verluste einschließt) zum Ende des Geschäftsjahres des Portefeuilles zahlbar, wodurch gegebenenfalls Leistungsgebühren auf unrealisierte Gewinne gezahlt werden, die anschließend unter Umständen nie realisiert werden. Darüber hinaus können Leistungsgebühren auch in Bezug auf ein Geschäftsjahr zahlbar sein, in dem es zu einem Rückgang des NIW je Anteil kam.

Der Referenzwert S&P 500 Index wird von einem Administrator bereitgestellt, der nicht in dem Register geführt wird, auf das in Artikel 36 von Verordnung (EU) 2016/1011" (die „Referenzwerte-Verordnung") Bezug genommen wird.

In Übereinstimmung mit der Verwendung des Referenzwerts für dieses Portefeuille können die Verfahren der Verwaltungsgesellschaft bezüglich der Referenzwerte-Verordnung auf Anfrage kostenlos beim eingetragenen Sitz der Verwaltungsgesellschaft angefordert werden.

Zum 31. Mai 2020 beliefen sich die durch das Select US Equity Portefeuille zahlbaren Leistungsgebühren auf $86. Diese sind im Posten „Aufgelaufene Passiva und sonstige Verbindlichkeiten" in der Vermögensaufstellung ausgewiesen.

Select Absolute Alpha Portfolio (wirksam bis 30. Oktober 2019)

Der Anlageverwalter erhält vom Portefeuille, mit Ausnahme der Anteilklasse S, einen Betrag in Höhe von 20% (10% für die Anteilklasse F und 15% für die Anteilklasse S13) des Betrags, um den der Nettoinventarwert jedes der relevanten Anteile des Portefeuilles am Ende des Geschäftsjahres (vor Abzug der Leistungsgebühr für das laufende Geschäftsjahr und nach Abzug der Managementgebühr) (der „bereinigte NIW") den „Prior High NAV" der betreffenden Anteile am Ende des jeweiligen Geschäftsjahres übersteigt.

Die Leistungsgebühr basiert auf dem „gewichteten Durchschnitt" der in Umlauf befindlichen Anteile während des Beobachtungszeitraums (wie in diesem Dokument definiert), solange der gewichtete Durchschnitt der Anteile die aktuell im Umlauf befindlichen Anteile nicht um mehr als 20% übersteigt. In Fällen, in denen der gewichtete Durchschnitt der Anteile die aktuell im Umlauf befindlichen Anteile um mehr als 20% übersteigt, wird die Leistungsgebühr auf der Grundlage der aktuell im Umlauf befindlichen Anteile berechnet. Die „gewichtete durchschnittliche Anzahl an Anteilen" entspricht der Gesamtanzahl an Anteilen, die an jedem einzelnen Tag des Geschäftsjahres, einschließlich Wochenenden, im Umlauf sind, geteilt durch die Gesamtanzahl der Tage, aus denen das Geschäftsjahr besteht. Der Anlageverwalter erhält diese Gebühr nur dann, wenn der bereinigte NIW je Anteil einer Anteilklasse höher ist als der „Prior High NAV" für den jeweiligen Betrachtungszeitraum.

Der „Prior High NAV" einer Anteilklasse ist der Nettoinventarwert jener Anteilklasse (angemessen berichtigt um eventuelle Rückzahlungen) unmittelbar nach der Wirksamkeit der letzten Leistungsgebühr, die in Bezug auf die Anteilklasse gezahlt worden ist, oder, falls zwei aufeinander folgende Jahre lang keine Leistungsgebühr gezahlt worden ist, der Nettoinventarwert der Anteile (entsprechend berichtigt um eventuelle Ausschüttungen) am Ende des Betrachtungszeitraums.

Die Verwaltungsgesellschaft legt einen Zweijahreszeitraum zur Ermittlung oder Neubestimmung des „Prior High NAV" zugrunde (der „Betrachtungszeitraum"). Zur Ermittlung der Dauer des Betrachtungszeitraums wird der folgende Mechanismus verwendet:

- Wenn am Ende des ersten Geschäftsjahres eine Leistungsgebühr angefallen und für die betreffenden Anteilklassen gezahlt worden ist, beginnt ein neuer Betrachtungszeitraum.
- Ist am Ende des ersten Geschäftsjahres keine Leistungsgebühr angefallen, erstreckt sich der Betrachtungszeitraum auf ein zweites Geschäftsjahr. Am Ende dieses zweiten Geschäftsjahres beginnt dann ein neuer Betrachtungszeitraum, vorausgesetzt, dass eine Leistungsgebühr angefallen und gezahlt worden ist.
- Ist am Ende des zweiten Geschäftsjahres keine Leistungsgebühr angefallen, beginnt unabhängig vom Anfallen und Auszahlen einer Leistungsgebühr ein neuer Betrachtungszeitraum.

Die ggf. fällige Leistungsgebühr ist jährlich nach Ablauf des Geschäftsjahres zu entrichten.

Wenn die Anteile der Klasse des Portefeuilles, der eine Leistungsgebühr berechnet wird, zu einem anderen Zeitpunkt als am Ende des Geschäftsjahres zurückgenommen werden, wird eine Leistungsgebühr für diese Anteile anteilig für das jeweilige Geschäftsjahr ermittelt und zu jenem Zeitpunkt ausbezahlt. Der „Prior High NAV" wird an den Handelstagen, an denen Leistungsgebühren nach der Rücknahme von Anteilen anfallen, nicht neu bestimmt.

Auf Basis der verwendeten Methode zur Berechnung der Leistungsgebühr muss das Portefeuille ggf. eine Leistungsgebühr bezahlen, selbst wenn es sich noch nicht vollständig von einer eventuellen Minderung des der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisenden Nettovermögens (wie um Zeichnungen, Rücknahmen, Dividenden und andere Ausschüttungen bereinigt) aus dem vergangenen Geschäftsjahr erholt hat.

Bei der Berechnung der Leistungsgebühren für Anteile der Klasse H wird die Verwaltungsgesellschaft die Auswirkungen von Aktivitäten zur Währungsabsicherung nicht berücksichtigen. Daher kann eine Leistungsgebühr für Anteile der Klasse H auflaufen und bezahlt werden, wenn der Nettoinventarwert dieser Anteile der Klasse H, einschließlich der Auswirkungen der Aktivitäten zur Währungsabsicherung, den „Prior High NAV" des entsprechenden Betrachtungszeitraums (um Währungsgewinne oder -verluste bereinigt) übersteigt.

Select Absolute Alpha Portfolio (mit Wirkung vom 31. Oktober 2019)
In der Regel erhält der Anlageverwalter vom Portfolio am Ende eines jeden Geschäftsjahres einen Betrag in Höhe von 20% (10% für Anteile der Klasse F und 15% für Anteile der Klasse S13) des Betrags, um den der Nettoinventarwert jedes der betreffenden Anteile des Portfolios am Ende dieses Geschäftsjahres (vor Abzug der Leistungsgebühr für das laufende Geschäftsjahr und nach Abzug der Managementgebühr) (der ***„bereinigte NIW"***) den „Prior High NAV" (wie nachfolgend definiert) der betreffenden Anteile am Ende dieses Geschäftsjahres übersteigt. Die Leistungsgebühr basiert auf dem ***„gewichteten Durchschnitt"*** der in Umlauf befindlichen Anteile, solange der gewichtete Durchschnitt der Anteile die aktuell im Umlauf befindlichen Anteile nicht um mehr als 20% übersteigt. In Fällen, in denen der gewichtete Durchschnitt der Anteile die aktuell im Umlauf befindlichen Anteile um mehr als 20% übersteigt, wird die Leistungsgebühr auf der Grundlage der aktuell im Umlauf befindlichen Anteile berechnet.

- Der „Prior High NAV" einer Anteilklasse ist der Nettoinventarwert der jeweiligen Klasse (gegebenenfalls angepasst um etwaige Ausschüttungen) unmittelbar nach Wirksamwerden der letzten Leistungsgebühr, die in Bezug auf diese Anteilklasse gezahlt wurde, oder – falls keine Leistungsgebühr gezahlt wurde – der Nettoinventarwert dieser betreffenden Anteilklassen.

Die eventuell anfallende Leistungsgebühr ist jährlich nach dem Ende eines jeden Geschäftsjahres zahlbar.

Falls die Anteilklassen des Portfolios, für die eine Leistungsgebühr erhoben wird, zu einem anderen Zeitpunkt als zum Ende eines Geschäftsjahres zurückgenommen werden, wird eine Leistungsgebühr in Bezug auf diese Anteile für den betreffenden Teil des Geschäftsjahres ermittelt und zu dem entsprechenden Datum gezahlt. Der „Prior High NAV" wird an den Handelstagen, an denen die Leistungsgebühren nach der Rücknahme von Anteilen ausgewiesen werden, nicht zurückgesetzt.

Bei der Berechnung der Leistungsgebühren für Anteile der Klasse H wird die Verwaltungsgesellschaft die Auswirkungen von Währungsabsicherungsaktivitäten nicht berücksichtigen. Daher kann eine Leistungsgebühr in Bezug auf Anteile der Klasse H anfallen und gezahlt werden, wenn der NIW dieser H-Anteile infolge der Auswirkungen von Währungsabsicherungen den „Prior High NAV" übersteigt.

Zum 31. Mai 2020 belief sich die für das Select Absolute Alpha Portfolio zu zahlende Leistungsgebühr auf $6,824,944. Diese ist unter „Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten" in der Zusammensetzung des Fondsvermögens enthalten.

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
International Health Care Portfolio				
A	1.77%(1)	0.05%	N/A	2.01%
A EUR H	1.77%(1)	0.05%	N/A	2.04%
AD	1.77%(1)	0.05%	N/A	2.01%
AX	1.27%(2)	0.05%	N/A	1.51%
B	1.77%(1)	0.05%	1.00%	3.01%
BX	1.27%(2)	0.05%	N/A	1.51%
C	2.22%(3)	0.05%	N/A	2.46%
ED	1.77%(1)	0.05%	1.00%	3.02%
I	0.97%(4)	0.05%	N/A	1.21%
I GBP	0.97%(4)	0.05%	N/A	1.16%
S1	0.90%	0.01%(13)	N/A	0.95%
S14 GBP	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.64%
International Technology Portfolio				
A	1.90%(5)	0.05%	N/A	2.15%
A PLN H	1.88%(5)	0.05%	N/A	2.17%
B	1.90%(5)	0.05%	1.00%	3.15%
C	2.34%(6)	0.05%	N/A	2.61%
E	1.89%(5)	0.05%	1.00%	3.17%
I	1.09%(7)	0.05%	N/A	1.35%
S1	0.90%	0.01%(13)	N/A	0.96%
Global Real Estate Securities Portfolio				
A	1.50%	0.05%	N/A	2.00%
AD	1.50%	0.05%	N/A	2.00%
AD AUD H	1.50%	0.05%	N/A	2.00%
AD NZD H	1.50%	0.05%	N/A	2.00%
AD SGD H	1.50%	0.05%	N/A	2.00%
B	1.50%	0.05%	1.00%	3.00%
BD	1.50%	0.05%	1.00%	3.00%
BD AUD H	1.50%	0.05%	1.00%	3.00%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.45%
I	0.70%	0.05%	N/A	1.20%
ID	0.70%	0.05%	N/A	1.20%
S1	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.75%

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
Sustainable Global Thematic Portfolio				
A	1.70%(8)	0.05%	N/A	1.96%
A AUD H	1.70%(8)	0.05%	N/A	1.97%
A EUR H	1.70%(8)	0.05%	N/A	1.90%
A SGD H	1.70%(8)	0.05%	N/A	1.96%
AN	1.70%(8)	0.05%	N/A	1.96%
AX	1.70%(8)	0.05%	N/A	1.96%
AXX	1.20%(9)	0.05%	N/A	1.46%
B	1.70%(8)	0.05%	1.00%	2.96%
B AUD H(a)	1.70%(8)	0.05%	1.00%	2.99%
B CAD H	1.70%(8)	0.05%	1.00%	2.98%
BX	1.70%(8)	0.05%	1.00%	2.96%
BXX	1.20%(9)	0.05%	N/A	1.46%
C	2.15%(10)	0.05%	N/A	2.41%
CX	2.15%(10)	0.05%	N/A	2.41%
I	0.90%(11)	0.05%	N/A	1.15%
I EUR H	0.90%(11)	0.05%	N/A	1.17%
IN	0.90%(11)	0.05%	N/A	1.16%
IX	0.90%(11)	0.05%	N/A	1.16%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
S GBP	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.75%
S1X	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.75%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
SX	N/A	0.01%(13)	N/A	0.04%
India Growth Portfolio				
A	1.75%	0.05%	N/A	2.15%
A PLN H	1.75%	0.05%	N/A	2.13%
A SGD H	1.75%	0.05%	N/A	2.16%
AD AUD H	1.75%	0.05%	N/A	2.09%
AX	1.54%(12)	0.05%	N/A	1.95%
B	1.75%	0.05%	1.00%	3.14%
BX	1.54%(12)	0.05%	1.00%	2.94%
C	2.20%	0.05%	N/A	2.56%
I	0.95%	0.05%	N/A	1.36%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.21%
S1	0.95%	0.01%(13)	N/A	1.17%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
Euro High Yield Portfolio				
Klasse				
A	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
A2	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
A2 CHF H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
A2 PLN H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
A2 USD H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AA	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AA AUD H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AA HKD H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AA RMB H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AA SGD H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AA USD H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AR	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AT	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AT AUD H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AT SGD H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
AT USD H	1.20%	0.05%	N/A	1.50%
B2	1.20%	0.05%	1.00%	2.50%
C	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
C2	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
CT USD H	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
I	0.65%	0.05%	N/A	0.95%
I2	0.65%	0.05%	N/A	0.95%
I2 CHF H	0.65%	0.05%	N/A	0.95%
I2 GBP H	0.65%	0.05%	N/A	0.95%
I2 USD H	0.65%	0.05%	N/A	0.95%
IT USD H	0.65%	0.05%	N/A	0.95%
NT USD H	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.09%
S1	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.68%
S1 USD H	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.69%
US Small and Mid-Cap Portfolio				
Klasse				
A	1.60%	0.05%	N/A	2.00%
A AUD H	1.60%	0.05%	N/A	2.00%
A EUR H	1.60%	0.05%	N/A	2.00%
A SGD H	1.60%	0.05%	N/A	2.00%
B	1.60%	0.05%	1.00%	3.00%
C	2.05%	0.05%	N/A	2.45%
C EUR H	2.05%	0.05%	N/A	2.45%
I	0.80%	0.05%	N/A	1.20%
I EUR H	0.80%	0.05%	N/A	1.20%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.12%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.90%
S1 EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.90%

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
A	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
A AUD H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
A CAD H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
A CHF H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
A EUR H	1.60%	0.05%	N/A	1.85%
A GBP H	1.60%	0.05%	N/A	1.85%
A SGD H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
AD	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
AD AUD H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
AD CAD H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
AD EUR H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
AD GBP H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
AD RMB H	1.60%	0.05%	N/A	1.86%
AD SGD H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
AD ZAR H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
AR	1.60%	0.05%	N/A	1.85%
AR EUR H	1.60%	0.05%	N/A	1.85%
B	1.60%	0.05%	1.00%	2.84%
BD	1.60%	0.05%	1.00%	2.84%
C	2.05%	0.05%	N/A	2.29%
ED	1.60%	0.05%	1.00%	2.85%
ED AUD H	1.60%	0.05%	1.00%	2.86%
ED ZAR H	1.60%	0.05%	1.00%	2.85%
I	0.80%	0.05%	N/A	1.05%
I CHF H	0.80%	0.05%	N/A	1.04%
I EUR H	0.80%	0.05%	N/A	1.02%
I GBP	0.80%	0.05%	N/A	1.02%
I GBP H	0.80%	0.05%	N/A	1.04%
ID	0.80%	0.05%	N/A	1.05%
ID GBP H	0.80%	0.05%	N/A	1.05%
N	2.05%	0.05%	N/A	2.29%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S1	0.80%	0.01%(13)	N/A	0.89%
S1 JPY	0.80%	0.01%(13)	N/A	0.89%
S1 JPY H	0.80%	0.01%(13)	N/A	0.89%
S1D	0.80%	0.01%(13)	N/A	0.89%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.09%
SQD GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.09%

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
RMB Income Plus Portfolio				
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AR EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.83%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.85%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.87%
IT	0.55%	0.05%	N/A	0.87%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.55%	0.01%(13)	N/A	0.68%
W2	0.39%(14)	0.05%	N/A	0.69%
Short Duration High Yield Portfolio				
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 SEK H(b)	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AR EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
B2	1.10%	0.05%	1.00%	2.31%
BT	1.10%	0.05%	1.00%	2.32%
BT CAD H	1.10%	0.05%	1.00%	2.31%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.77%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.77%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.76%
I2 GBP H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
IT	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
IT GBP H	0.55%	0.05%	N/A	0.76%
IT SGD H	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.86%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.57%
S1QD EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.58%
W2 CHF H	0.39%(14)	0.05%	N/A	0.59%

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
Select US Equity Portfolio				
A	1.80%	0.05%	N/A	2.00%
A AUD H	1.80%	0.05%	N/A	1.97%
A CHF H	1.80%	0.05%	N/A	2.00%
A CZK H	1.80%	0.05%	N/A	1.98%
A EUR H	1.80%	0.05%	N/A	2.00%
A GBP H	1.80%	0.05%	N/A	2.00%
A PLN H	1.80%	0.05%	N/A	1.97%
A SGD H	1.80%	0.05%	N/A	2.00%
AR	1.80%	0.05%	N/A	2.00%
AR EUR H	1.80%	0.05%	N/A	2.00%
C	2.25%	0.05%	N/A	2.45%
F	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.53%
F EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.53%
I	1.00%	0.05%	N/A	1.20%
I CHF H	1.00%	0.05%	N/A	1.20%
I EUR H	1.00%	0.05%	N/A	1.19%
I GBP H	1.00%	0.05%	N/A	1.19%
I SGD H	1.00%	0.05%	N/A	1.20%
N	2.25%	0.05%	N/A	2.45%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.03%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.04%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.03%
S1	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.78%
S1 EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.78%
S1 GBP H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.78%
S1 JPY	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.78%
S1 JPY H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.78%
S1 SGD H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.78%
W	0.20%	0.05%	N/A	0.40%
W CHF H	0.20%	0.05%	N/A	0.40%
W EUR H	0.20%	0.05%	N/A	0.40%
W GBP H	0.20%	0.05%	N/A	0.40%
W SGD H	0.20%	0.05%	N/A	0.40%
Global Plus Fixed Income Portfolio				
1	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.90%
1 EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.90%
1 GBP H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.90%
1D	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.90%
1D EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.90%
1D GBP H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.90%
2	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.82%
2 EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.84%
2 GBP H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.79%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
A2 SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AR EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
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	1.36%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
Global Plus Fixed Income Portfolio (Fortsetzung)				
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
BT	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT CAD H	1.10%	0.05%	1.00%	2.36%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.81%
C2 EUR H	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.81%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
I2 GBP H	0.55%	0.05%	N/A	0.81%
IK EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.81%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S CAD H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.58%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.54%
S1 NOK H(c)	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.57%
SA	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
Select Absolute Alpha Portfolio				
A	1.80%	0.05%	N/A	2.04%
A AUD H	1.80%	0.05%	N/A	2.04%
A CHF H	1.80%	0.05%	N/A	2.04%
A EUR H	1.80%	0.05%	N/A	2.04%
A GBP H	1.80%	0.05%	N/A	2.04%
A PLN H	1.80%	0.05%	N/A	2.02%
A SGD H	1.80%	0.05%	N/A	2.04%
C	2.25%	0.05%	N/A	2.49%
F	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.57%
F EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.57%
I	1.00%	0.05%	N/A	1.23%
I CHF H	1.00%	0.05%	N/A	1.23%
I EUR H	1.00%	0.05%	N/A	1.23%
I GBP H	1.00%	0.05%	N/A	1.23%
N	2.25%	0.05%	N/A	2.49%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S1	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.05%
S1 EUR H	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.07%
S1 GBP H	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.06%
S1 JPY H	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.08%
S13 EUR H	0.99%	0.01%(13)	N/A	0.99%
W	0.80%(15)	0.05%	N/A	1.02%
W CHF H	0.80%(15)	0.05%	N/A	1.02%

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio				
A2	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
A2 CZK H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
A2 EUR H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
A2 PLN H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AA	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT SGD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
I2	0.75%	0.05%	N/A	1.20%
I2 EUR H	0.75%	0.05%	N/A	1.20%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.12%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.83%
SA	N/A	0.01%(13)	N/A	0.13%
ZT	N/A	N/A	N/A	0.01%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio				
A2	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
A2 AUD H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
A2 EUR H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
A2 SGD H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AA	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AA AUD H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AA CAD H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AA EUR H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AA GBP H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AA SGD H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AR EUR H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AT	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AT AUD H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AT CAD H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AT EUR H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AT GBP H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
AT SGD H	1.20%	0.05%	N/A	1.60%
B2	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT AUD H	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT CAD H	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT EUR H	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT GBP H	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
C2	1.65%	0.05%	N/A	2.05%
C2 EUR H	1.65%	0.05%	N/A	2.05%
I2	0.65%	0.05%	N/A	1.05%
I2 EUR H	0.65%	0.05%	N/A	1.05%
I2 SGD H	0.65%	0.05%	N/A	1.05%
IT	0.65%	0.05%	N/A	1.05%
IT AUD H	0.65%	0.05%	N/A	1.05%
IT EUR H	0.65%	0.05%	N/A	1.05%
IT SGD H	0.65%	0.05%	N/A	1.05%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.80%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
Emerging Market Corporate Debt Portfolio				
Klasse				
A2	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
A2 AUD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
A2 CAD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
A2 EUR H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
A2 GBP H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
A2 SGD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AA	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AA AUD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AA SGD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AR EUR	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT AUD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT CAD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT EUR H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT GBP H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT NZD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT RMB H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
AT SGD H	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
C2	1.75%	0.05%	N/A	2.20%
CT	1.75%	0.05%	N/A	2.20%
I2	0.75%	0.05%	N/A	1.20%
I2 EUR H	0.75%	0.05%	N/A	1.20%
IT	0.75%	0.05%	N/A	1.20%
N2	1.85%	0.05%	N/A	2.30%
NT	1.85%	0.05%	N/A	2.30%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.85%
US High Yield Portfolio				
Klasse				
A2	1.20%	0.05%	N/A	1.55%
A2 EUR H	1.20%	0.05%	N/A	1.55%
AT(d)	1.20%	0.05%	N/A	1.55%
C2	1.65%	0.05%	N/A	2.00%
I2	0.65%	0.05%	N/A	1.00%
I2 EUR H	0.65%	0.05%	N/A	1.00%
N2	1.75%	0.05%	N/A	2.10%
NT	1.75%	0.05%	N/A	2.10%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.65%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.65%
ZT	N/A	N/A	N/A	0.01%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
Low Volatility Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A EUR	1.50%	0.05%	N/A	1.72%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A NZD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A PLN H	1.50%	0.05%	N/A	1.69%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD CAD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD GBP H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD NZD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD RMB H	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
AD SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD ZAR H	1.50%	0.05%	N/A	1.75%
AR	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AR EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.15%
ED	1.50%	0.05%	1.00%	2.71%
ED AUD H	1.50%	0.05%	1.00%	2.73%
ED ZAR H	1.50%	0.05%	1.00%	2.71%
I	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I EUR	0.70%	0.05%	N/A	0.93%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I GBP	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
I GBP H	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
I SGD H	0.70%	0.05%	N/A	0.90%
N	1.95%	0.05%	N/A	2.15%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.55%
S1 EUR	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.53%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.54%
S1D	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.55%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
AD	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
AD AUD H	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
AD CAD H	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
AD EUR H	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
AD GBP H	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
AD NZD H	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
AD SGD H	1.65%	0.05%	N/A	1.95%
F	0.425%	0.01%(13)	N/A	0.50%
F EUR H	0.425%	0.01%(13)	N/A	0.49%
I	0.85%	0.05%	N/A	1.15%
I GBP H	0.85%	0.05%	N/A	1.15%
I SGD H	0.85%	0.05%	N/A	1.15%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S EUR	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
S GBP	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S1	0.85%	0.01%(13)	N/A	0.90%
Global Dynamic Bond Portfolio				
Klasse				
A2 CHF H	1.00%(m)	0.05%	N/A	1.45%
A2 EUR H	1.00%(m)	0.05%	N/A	1.45%
A2 SGD H	1.00%(m)	0.05%	N/A	1.45%
A2 USD H	1.00%(m)	0.05%	N/A	1.45%
AR EUR H	1.00%(m)	0.05%	N/A	1.45%
I2	0.50%(n)	0.05%	N/A	0.90%
I2 CHF H	0.50%(n)	0.05%	N/A	0.90%
I2 EUR H	0.50%(n)	0.05%	N/A	0.90%
I2 USD H	0.50%(n)	0.05%	N/A	0.90%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S USD H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S1	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.52%
S1 EUR H	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.52%
S1 SGD H	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.52%
S1 USD H	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.52%
S1QD	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.52%
SQD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
Global Equity Income Portfolio (e)				
Klasse				
A	1.50%	0.05%	N/A	1.80%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.80%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.80%
AD	1.50%	0.05%	N/A	1.80%
AD SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.80%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.25%
C EUR H	1.95%	0.05%	N/A	2.25%
CD	1.95%	0.05%	N/A	2.25%
I	0.70%	0.05%	N/A	1.00%
I CHF H	0.70%	0.05%	N/A	1.00%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	1.00%
I GBP H	0.70%	0.05%	N/A	1.00%
N	1.95%	0.05%	N/A	2.25%
ND	1.95%	0.05%	N/A	2.25%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	1.00%
S1 GBP	0.70%	0.01%(13)	N/A	1.00%
Concentrated US Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.60%	0.05%	N/A	1.81%
A AUD H	1.60%	0.05%	N/A	1.82%
A EUR	1.60%	0.05%	N/A	1.80%
A EUR H	1.60%	0.05%	N/A	1.85%
A SGD H	1.60%	0.05%	N/A	1.84%
AR EUR	1.60%	0.05%	N/A	1.81%
C	2.05%	0.05%	N/A	2.26%
I	0.80%	0.05%	N/A	1.01%
I AUD H	0.80%	0.05%	N/A	1.00%
I CHF H	0.80%	0.05%	N/A	1.00%
I EUR H	0.80%	0.05%	N/A	1.01%
I GBP	0.80%	0.05%	N/A	1.00%
I GBP H	0.80%	0.05%	N/A	1.01%
I SGD H	0.80%	0.05%	N/A	1.02%
N	2.05%	0.05%	N/A	2.26%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S1	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.81%
S1 EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.81%
S1 GBP H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.81%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
Concentrated Global Equity Portfolio				
A	1.70%	0.05%	N/A	1.97%
A EUR H	1.70%	0.05%	N/A	1.96%
A SGD H	1.70%	0.05%	N/A	2.00%
AR EUR	1.70%	0.05%	N/A	1.98%
C	2.15%	0.05%	N/A	2.43%
I	0.85%(o)	0.05%	N/A	1.16%
I CAD H	0.85%(o)	0.05%	N/A	1.16%
I CHF H	0.85%(o)	0.05%	N/A	1.17%
I EUR	0.85%(o)	0.05%	N/A	1.18%
I EUR H	0.85%(o)	0.05%	N/A	1.16%
I GBP	0.85%(o)	0.05%	N/A	1.14%
I GBP H	0.85%(o)	0.05%	N/A	1.16%
N	2.15%	0.05%	N/A	2.41%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S GBP	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S1	0.85%	0.01%(13)	N/A	0.93%
S1 EUR H	0.85%	0.01%(13)	N/A	0.91%
Global Core Equity Portfolio				
A	1.50%	0.05%	N/A	1.82%
A AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.78%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.79%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.78%
AR EUR	1.50%	0.05%	N/A	1.79%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.29%
I	0.70%	0.05%	N/A	1.00%
I AUD H	0.70%	0.05%	N/A	0.99%
I CHF H	0.70%	0.05%	N/A	0.99%
I EUR	0.70%	0.05%	N/A	1.08%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	0.98%
I GBP H	0.70%	0.05%	N/A	1.00%
I SGD H	0.70%	0.05%	N/A	0.98%
IX EUR	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.71%
N	1.95%	0.05%	N/A	2.26%
RX EUR	1.75%	0.05%	N/A	1.99%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.04%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S NOK HP	N/A	0.01%(13)	N/A	0.04%
S1	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.66%
S1 EUR H	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.63%
S1 NOK HP	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.67%
S1X EUR(f)	0.375%	0.01%(13)	N/A	0.425%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
XX EUR(g)	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.55%
XX GBP(h)	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.51%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
Global Income Portfolio				
Klasse				
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 PLN H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 CAD H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 GBP H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 SGD H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
IT	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
IT AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
IT CAD H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
IT SGD H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.13%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.11%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.11%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.61%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.60%
S1 GBP H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.60%
Alternative Risk Premia Portfolio				
Klasse				
F	0.35%	0.01%(13)	N/A	0.55%
F EUR H	0.35%	0.01%(13)	N/A	0.57%
F GBP H	0.35%	0.01%(13)	N/A	0.55%
I	0.70%	0.05%	N/A	0.95%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	0.95%
I GBP H	0.70%	0.05%	N/A	0.95%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.85%
S1 EUR H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.85%
S1 GBP H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.85%
S1QD(i)	0.20%	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1QD EUR H(i)	0.20%	0.01%(13)	N/A	0.15%
S3 AUD H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
European Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
A AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.84%
A HKD H	1.50%	0.10%	N/A	1.93%
A SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
A USD H	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
AD	1.50%	0.10%	N/A	1.87%
AD AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
AD SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
AD USD H	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
B	1.50%	0.10%	1.00%	2.83%
BD(j)	1.50%	0.10%	1.00%	2.80%
BD AUD H	1.50%	0.10%	1.00%	2.81%
BD USD H	1.50%	0.10%	1.00%	2.83%
C	1.95%	0.10%	N/A	2.29%
C USD H	1.95%	0.10%	N/A	2.26%
I	0.70%	0.10%	N/A	1.04%
I GBP	0.70%	0.10%	N/A	1.07%
I USD H	0.70%	0.10%	N/A	1.02%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
S1	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.68%
S1 GBP	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.69%
S1NN	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.68%
S1X	0.55%	0.01%(13)	N/A	0.63%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
Eurozone Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
A AUD H	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
A PLN H	1.55%	0.10%	N/A	1.84%
A SGD H	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
A USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
AR	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
AX	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
BX	1.50%	0.10%	1.00%	2.77%
C	2.00%	0.10%	N/A	2.27%
C USD H	2.00%	0.10%	N/A	2.27%
CX	1.95%	0.10%	N/A	2.23%
I	0.75%	0.10%	N/A	1.03%
I GBP	0.75%	0.10%	N/A	1.01%
I USD H	0.75%	0.10%	N/A	1.02%
INN	0.75%	0.10%	N/A	1.02%
IX	0.70%	0.10%	N/A	0.97%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
S1	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.70%
S1 GBP	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.69%
S1 USD H	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.70%
S1N	0.50%(14)	0.01%(13)	N/A	0.55%
S1N USD	0.50%(14)	0.01%(13)	N/A	0.55%

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
American Growth Portfolio				
A	1.50%	0.10%	N/A	1.75%
A EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.75%
A PLN H	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
A SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD	1.50%	0.10%	N/A	1.76%
AD AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.76%
AD RMB H	1.50%	0.10%	N/A	1.76%
AD ZAR H	1.50%	0.10%	N/A	1.76%
AX	0.92%	0.10%	N/A	1.17%
B	1.50%	0.10%	1.00%	2.75%
B EUR H(k)	1.50%	0.10%	1.00%	2.71%
BD	1.50%	0.10%	1.00%	2.75%
BD AUD H(l)	1.50%	0.10%	1.00%	2.71%
BD ZAR H	1.50%	0.10%	1.00%	2.74%
BX	0.92%	0.10%	N/A	1.17%
C	1.95%	0.10%	N/A	2.20%
C EUR H	1.95%	0.10%	N/A	2.20%
ED	1.50%	0.10%	1.00%	2.77%
I	0.70%	0.10%	N/A	0.96%
I EUR H	0.70%	0.10%	N/A	0.95%
I GBP	0.70%	0.10%	N/A	0.96%
I GBP H	0.70%	0.10%	N/A	0.97%
N	1.95%	0.10%	N/A	2.20%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.03%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.03%
S1	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.68%
S1 EUR H	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.68%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.03%
SK	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.73%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
All Market Income Portfolio				
Klasse				
A	1.50%	0.10%	N/A	1.84%
A CHF H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
A EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
A HKD	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
A SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
A2X	1.15%	0.10%	N/A	1.48%
AD	1.50%	0.10%	N/A	1.84%
AD AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
AD CAD H	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
AD EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.84%
AD GBP H	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
AD HKD	1.50%	0.10%	N/A	1.84%
AD NZD H	1.50%	0.10%	N/A	1.84%
AD RMB H	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
AD SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.84%
AD ZAR H	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
AMG	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
AMG EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
ANN	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
ANN EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
AQG	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
AQG EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
AR EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
AX	1.15%	0.10%	N/A	1.48%
B	1.50%	0.10%	1.00%	2.83%
B2X	1.15%	0.10%	1.00%	2.48%
BX	1.15%	0.10%	1.00%	2.48%
C	1.95%	0.10%	N/A	2.28%
C2X	1.60%	0.10%	N/A	1.93%
CD	1.95%	0.10%	N/A	2.29%
CX	1.60%	0.10%	N/A	1.93%
ED	1.50%	0.10%	1.00%	2.85%
ED AUD H	1.50%	0.10%	1.00%	2.85%
ED ZAR H	1.50%	0.10%	1.00%	2.85%
I	0.70%	0.10%	N/A	1.04%
I CHF H	0.70%	0.10%	N/A	1.01%
I EUR H	0.70%	0.10%	N/A	1.03%
I SGD H	0.70%	0.10%	N/A	1.03%
ID	0.70%	0.10%	N/A	1.04%
IMG	0.70%	0.10%	N/A	1.02%
IMG EUR H	0.70%	0.10%	N/A	1.01%
INN	0.70%	0.10%	N/A	1.05%
INN EUR H	0.70%	0.10%	N/A	1.01%
INN GBP H	0.70%	0.10%	N/A	1.01%
IQG	0.70%	0.10%	N/A	1.02%
IQG EUR H	0.70%	0.10%	N/A	1.01%
N	1.95%	0.10%	N/A	2.28%
ND	1.95%	0.10%	N/A	2.28%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.81%
S1 CHF H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.79%
S1 EUR H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.81%
S1 GBP H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.78%
S1D JPY H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.81%
S1QG GBP H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.79%

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
China A Shares Equity Portfolio				
A	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A AUD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A CAD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A EUR	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A HKD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A NZD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A SGD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A USD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A USD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD HKD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD HKD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD SGD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD USD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
I	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
I GBP	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
I USD H	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.20%
S USD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.20%
S1	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.95%
S1 EUR	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.95%
SP1 USD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.20%
Financial Credit Portfolio				
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 GBP H	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
IT	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.11%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.55%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.55%
S1 GBP H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.55%
ZT	N/A	N/A	N/A	0.01%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio				
A2	0.90%	0.05%	N/A	1.08%
I2	0.45%	0.05%	N/A	0.63%
I2 GBP H	0.45%	0.05%	N/A	0.63%
I2 USD H	0.45%	0.05%	N/A	0.63%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.40%	0.01%(13)	N/A	0.55%
S1 GBP H	0.40%	0.01%(13)	N/A	0.55%
S1 USD H	0.40%	0.01%(13)	N/A	0.55%

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

(a) Die Anteilklasse wurde am 20. Juni 2019 aufgelöst.

(b) Die Anteilklasse wurde am 29. November 2019 aufgelöst.

(c) Die Anteilklasse wurde am 26. August 2019 aufgelöst.

(d) Die Anteilklasse wurde am 17. März 2020 aufgelöst.

(e) Der letzte Nettoinventarwert wurde am 9. Dezember 2019 berechnet.

(f) Die Anteilklasse wurde am 5. März 2020 aufgelöst.

(g) Die Anteilklasse wurde am 13. März 2020 aufgelöst.

(h) Die Anteilklasse wurde am 3. Juli 2019 aufgelöst.

(i) Die Anteilklasse wurde am 27. Mai 2020 aufgelöst.

(k) Die Anteilklasse wurde am 4. November 2019 aufgelöst.

(j) Die Anteilklasse wurde am 21. Januar 2020 aufgelöst.

(l) Die Anteilklasse wurde am 8. Oktober 2019 aufgelöst.

(m) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 29. Mai 2020 von 1.10% auf 1.00% gesenkt.

(n) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 29. Mai 2020 von 0.55% auf 0.50% gesenkt.

(o) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 29. Mai 2020 von 0.90% auf 0.85% gesenkt.

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

(1) 1.80% bis zu $300,000,000, 1.75% bei über $300,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(2) 1.30% bis zu $300,000,000, 1.25% bei über $300,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(3) 2.25% bis zu $300,000,000, 2.20% bei über $300,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(4) 1.00% bis zu $300,000,000, 0.95% bei über $300,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(5) 2.00% bis zu $300,000,000, 1.75% bei über $300,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(6) 2.45% bis zu $300,000,000, 2.20% bei über $300,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(7) 1.20% bis zu $300,000,000, 0.95% bei über $300,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(8) 1.70% bis zu $1,250,000,000, 1.50% bei über $1,250,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(9) 1.20% bis zu $1,250,000,000, 1.00% bei über $1,250,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(10) 2.15% bis zu $1,250,000,000, 1.95% bei über $1,250,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(11) 0.90% bis zu $1,250,000,000, 0.70% bei über $1,250,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

(12) 1.55% bis zu $50,000,000, 1.50% für die nächsten $50,000,000, 1.40% bei über $100,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das gesamte Nettovermögen der Klassen AX und BX.

Gebühr der Verwaltungsgesellschaft

(13) Jährliche Gebühr in Höhe von $50,000 oder 0.01% des tagesdurchschnittlichen NIW, je nachdem welcher Betrag niedriger ist.

Maximale Verwaltungsgebühr gemäß den Angaben im Prospekt des Fonds

(14) Max. 0.55%

(15) Max. 1.00%

	Umsatz*
AB SICAV I–	
International Health Care Portfolio	-87.72%
International Technology Portfolio	31.16%
Global Real Estate Securities Portfolio	48.47%
Sustainable Global Thematic Portfolio	54.85%
India Growth Portfolio	73.79%
Euro High Yield Portfolio	70.30%
US Small and Mid-Cap Portfolio	34.62%
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	194.08%
RMB Income Plus Portfolio	58.75%
Short Duration High Yield Portfolio	-19.02%
Select US Equity Portfolio	269.36%
Global Plus Fixed Income Portfolio	198.34%
Select Absolute Alpha Portfolio	291.27%
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	197.85%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	57.67%
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	176.58%
US High Yield Portfolio	87.01%
Low Volatility Equity Portfolio	-42.22%
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	88.90%
Global Dynamic Bond Portfolio	228.93%
Concentrated US Equity Portfolio	-32.95%
Concentrated Global Equity Portfolio	-15.16%
Global Core Equity Portfolio	33.24%
Global Income Portfolio	111.57%
Alternative Risk Premia Portfolio	231.14%
European Equity Portfolio	-2.74%
Eurozone Equity Portfolio	-10.51%
American Growth Portfolio	-60.02%
All Market Income Portfolio	88.97%
China A Shares Equity Portfolio	103.98%
Financial Credit Portfolio	394.55%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	255.10%

* Ungeprüft.

An die Anteilinhaber von AB SICAV I

Bestätigungsvermerk
Wir haben den Jahresabschluss von AB SICAV I (der „Fonds“) und der einzelnen Portefeuilles geprüft, der aus der Zusammensetzung des Fondsvermögens und dem Wertpapierbestand zum 31. Mai 2020, der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens für das zu diesem Zeitpunkt abgelaufene Geschäftsjahr und den Anmerkungen zum Jahresabschluss, darunter eine Zusammenfassung der relevanten Bilanzierungsgrundsätze, besteht.

Wir sind der Ansicht, dass der Jahresabschluss in Übereinstimmung mit den gesetzlichen und aufsichtsbehördlichen Vorschriften Luxemburgs für die Erstellung und Präsentation von Jahresabschlüssen eine wahrheitsgetreue und angemessene Darstellung der finanziellen Lage des Fonds und jedes seiner Portefeuilles zum 31. Mai 2020 sowie der Ergebnisse seiner Investitionstätigkeit und der Entwicklung seines Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt ablaufende Geschäftsjahr liefert.

Grundlage für den Bestätigungsvermerk
Wir haben unsere Abschlussprüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über die Prüfungstätigkeit (das „Gesetz vom 23. Juli 2016“) und den in Luxemburg von der *„Commission de Surveillance du Secteur Financier“* (CSSF) umgesetzten Internationalen Abschlussprüfungsgrundsätzen (ISA) durchgeführt. Unsere Pflichten gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und ISA sind im Abschnitt „Pflichten des *‹Réviseur d’entreprises agréé›* bei der Abschlussprüfung“ in unserem Bericht näher beschrieben. Wir sind gemäß dem vom internationalen Rat für die Verabschiedung von Standards zur Berufsethik für Wirtschaftsprüfer (International Ethics Standards Board for Accountants, IESBA) herausgegebenen Kodex der ethischen Grundsätze für den Berufsstand (Code of Ethics for Professional Accountants – IESBA-Code) in der von der CSSF in Luxemburg umgesetzten Form sowie den für unsere Prüfung des Abschlusses relevanten ethischen Anforderungen von dem Fonds unabhängig und sind unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäß diesen Anforderungen gerecht geworden. Wir halten die uns vorgelegten Belege für eine ausreichende und angemessene Grundlage für unseren Bestätigungsvermerk.

Sonstige Informationen
Der Verwaltungsrat des Fonds ist für die sonstigen Informationen verantwortlich. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, jedoch nicht den Abschluss und unseren dazugehörigen Bericht des *„Réviseur d’entreprises agréé“*.

Unser Bestätigungsvermerk zum Abschluss bezieht sich nicht auf die sonstigen Informationen. Dementsprechend geben wir diesbezüglich keinerlei Art von Prüfungsurteil ab.

In Verbindung mit unserer Prüfung des Abschlusses sind wir dafür verantwortlich, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei zu beurteilen, ob die sonstigen Informationen wesentlich im Widerspruch zum Abschluss oder zu unserem bei der Abschlussprüfung erlangten Wissen stehen oder anderweitig wesentlich falsch dargestellt erscheinen. Wenn wir basierend auf der von uns durchgeführten Arbeit zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche falsche Darstellung dieser sonstigen Informationen vorliegt, müssen wir über diese Tatsache berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

Pflichten des Verwaltungsrats des Fonds in Bezug auf den Abschluss
Die Erstellung und die den tatsächlichen Verhältnissen entsprechende Darstellung dieses Abschlusses gemäß den in Luxemburg geltenden gesetzlichen Bestimmungen und Verordnungen zur Erstellung und Darstellung von Abschlüssen liegen in der Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds, ebenso wie die Einrichtung eines internen Kontrollsystems, das nach Ansicht des Verwaltungsrats des Fonds erforderlich ist, um bei der Erstellung des Abschlusses sicherzustellen, dass dieser frei von wesentlichen falschen Darstellungen ist, unabhängig davon, ob diese aus dolosen Handlungen oder Irrtümern resultieren.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat des Fonds verantwortlich für die Beurteilung des Fonds und aller seiner Portefeuilles zur Unternehmensfortführung. Dabei muss er Angelegenheiten, die sich auf die Unternehmensfortführung und die Verwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung beziehen, gegebenenfalls offenlegen, es sei denn, der Verwaltungsrat des Fonds hat die Absicht, den Fonds oder eines seiner Portefeuilles zu liquidieren oder die Geschäftstätigkeit einzustellen, bzw. hat keine realistische Alternative zu diesem Vorgehen.

Pflichten des *„Réviseur d’entreprises agréé“* bei der Abschlussprüfung
Das Ziel unserer Prüfung ist es, eine angemessene Sicherheit darüber zu erlangen, ob der Abschluss insgesamt frei von wesentlichen falschen Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern ist, und einen Bericht des *„Réviseur d’entreprises agréé“* zu erstellen, der unseren Bestätigungsvermerk enthält. Die angemessene Sicherheit stellt einen hohen Grad an Sicherheit dar, ist jedoch keine Garantie dafür, dass bestehende wesentliche falsche Darstellungen bei einer gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISA durchgeführten Abschlussprüfung immer entdeckt werden. Falsche Darstellungen können durch dolose Handlungen oder Irrtümer entstehen und gelten als wesentlich, wenn vernünftigerweise erwartet werden kann, dass sie einzeln oder insgesamt die wirtschaftlichen Entscheidungen von Nutzern beeinflussen, die auf der Grundlage dieses Abschlusses getroffen werden.

Im Rahmen unserer Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den in Luxemburg von der CSSF umgesetzten ISA gehen wir während der gesamten Abschlussprüfung nach pflichtgemäßem Ermessen und mit professioneller Skepsis vor. Des Weiteren umfasst unsere Prüfung:

- Die Identifizierung und Beurteilung des Risikos wesentlicher falscher Darstellungen im Abschluss aufgrund von dolosen Handlungen oder Irrtümern, die Planung und Durchführung von Prüfungshandlungen als Reaktion auf diese Risiken und die Erlangung von Prüfungsnachweisen, die als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen sind. Das Risiko, dass wesentliche falsche Darstellungen aufgrund von dolosen Handlungen nicht entdeckt werden, ist höher als bei wesentlichen falschen Darstellungen, die aus Irrtümern resultieren, da dolose Handlungen geheime Absprachen, Fälschungen, gezielte Auslassungen, falsche Angaben wesentlicher Umstände oder die Umgehung interner Kontrollen beinhalten können.
- Die Erlangung eines Verständnisses der für die Abschlussprüfung relevanten internen Kontrollen, um den

Umständen angemessene Prüfungsverfahren zu erarbeiten, jedoch nicht, um eine Meinung über die Wirksamkeit der internen Kontrollen des Fonds abzugeben.

- Die Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und der vom Verwaltungsrat des Fonds vorgenommenen Schätzungen und der damit im Zusammenhang stehenden Offenlegungen.
- Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat des Fonds bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist und ob auf der Grundlage der erlangten Prüfungsnachweise eine wesentliche Unsicherheit in Bezug auf Ereignisse oder Bedingungen besteht, die die Fähigkeit des Fonds oder seiner einzelnen Portefeuilles zur Fortführung der Unternehmenstätigkeit ernsthaft in Zweifel stellen könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, im Bericht des *„Réviseur d'entreprises agréé"* auf die entsprechenden Offenlegungen im Abschluss hinzuweisen bzw. unseren Bestätigungsvermerk zu ändern, falls die Offenlegungen unangemessen sind. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum unseres Berichts des *„Réviseur d'entreprises agréé"* erlangten Prüfungsnachweisen. Zukünftige Ereignisse oder Bedingungen können jedoch dazu führen, dass der Fonds oder eines seiner Portefeuilles (mit Ausnahme der Portefeuilles, bei denen ein Beschluss oder die Absicht zur Schließung besteht) nicht mehr nach dem Grundsatz der Unternehmensfortführung weitergeführt wird.
- In Bezug auf Portefeuilles, bei denen ein Beschluss oder die Absicht zur Schließung besteht, ziehen wir eine Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat des Fonds bei der Erstellung des Abschlusses angewandte Grundsatz der Unternehmensfortführung angemessen ist. Wir bewerten auch die Angemessenheit der Angaben, die die Nichtanwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung bei der Rechnungslegung und die Gründe für seine Anwendung beschreiben. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum unseres Berichts des *„Réviseur d'entreprises agréé"* erlangten Prüfungsnachweisen.
- Die Beurteilung der Gesamtdarstellung und Struktur des Abschlusses sowie seines Inhalts, einschließlich der Offenlegungen und der Frage, ob die zugrunde liegenden Transaktionen und Ereignisse im Abschluss so dargestellt sind, dass ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild erreicht wird.

Wir kommunizieren mit den mit der Unternehmensführung Beauftragten unter anderem in Bezug auf den geplanten Umfang und den Zeitplan für die Abschlussprüfung sowie bedeutsame Prüfungsfeststellungen, einschließlich eventueller bedeutsamer Mängel im internen Kontrollsystem, die wir während unserer Prüfung entdecken.

Wir geben den mit der Unternehmensführung beauftragten Personen gegenüber zudem eine Erklärung ab, dass wir die relevanten ethischen Anforderungen in Bezug auf die Unabhängigkeit erfüllt haben, und teilen ihnen alle Beziehungen und sonstigen Sachverhalte mit, von denen vernünftigerweise angenommen werden kann, dass sie sich auf unsere Unabhängigkeit auswirken, sowie gegebenenfalls die demgegenüber getroffenen Schutzvorkehrungen.

Ernst & Young
Société anonyme
Cabinet de révision agréé

Kerry Nichol
Luxemburg, 16. September 2020

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 das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungsdienstleistungen für die nachstehend aufgeführten Portefeuilles an die folgenden verbundenen Unteranlageverwalter übertragen:

AllianceBernstein Limited:

- All Market Income Portfolio
- Concentrated Global Equity Portfolio
- Euro High Yield Portfolio
- European Equity Portfolio
- Eurozone Equity Portfolio
- Financial Credit Portfolio
- Global Dynamic Bond Portfolio
- Global Income Portfolio
- Global Plus Fixed Income Portfolio

AllianceBernstein Hong Kong Limited:

- Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio
- China A Shares Equity Portfolio
- Emerging Markets Local Currency Debt Portfolio
- Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio
- RMB Income Plus Portfolio

AllianceBernstein (Singapore) Ltd.:

- India Growth Portfolio

CPH Capital Fondsmæglerselskab A/S:

- Global Core Equity 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.

Der Verkaufsprospekt und die Dokumente mit den wesentlichen Anlegerinformationen, 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

BNP Paribas Securities Services
Rue de Loxum 25
1000 Brüssel
Belgien

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

Skandinaviska Enskilda Banken AB (publ)
Råsta Strandväg 5
169 79 Solna
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, Zweigniederlassung Mailand
Via Ansperto 5
Mailand
Italien

Allfunds Bank, S.A. Zweigniederlassung Mailand
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

AllianceBernstein Limited
50 Berkeley Street
London W1J 8HA
Großbritannien

Allfunds Bank S.A.U.
Calle de los Padres Dominicos, 7
28050, Madrid
Spanien

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

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

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

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 Verkaufsprospekt, die wesentlichen Anlegerinformationen, die Satzung des Fonds, 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 Vertreter in der Schweiz, BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, Selnaustrasse 16, CH-8002 Zürich, Schweiz, erhältlich.

Die Veröffentlichungen des Fonds in der Schweiz erfolgen auf www.fundinfo.com. Die Ausgabe- und Rücknahmepreise der Fondsanteile bzw. der NIW je Anteil (mit dem Hinweis „ohne Provisionen“) werden gemeinsam und täglich auf www.fundinfo.com veröffentlicht.

Bitte beachten Sie, dass das International Health Care Portfolio mit Wirkung vom 24. September 2008 CPF-Mitgliedern nicht länger zur Anlage unter Verwendung von CPF-Geldern zur Verfügung steht. Dieses Portefeuille untersteht jedoch weiter den vom CPF-Vorstand Singapur erstellten Anlagerichtlinien (die „CPF-Anlagerichtlinien“), da diese von Zeit zu Zeit vom CPF-Vorstand geändert, ergänzt, neu erlassen oder neu verfasst werden können.

Der Nettoinventarwert der Portefeuilles des Fonds wird täglich auf www.alliancebernstein.com veröffentlicht.

Die Dokumente mit wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) des Fonds stehen unter www.alliancebernstein.com/go/kiid zur Verfügung.

Mitteilungen an die Anteilinhaber
Soweit laut Gesetzgebung und anwendbarer Bestimmungen vorgeschrieben, werden Mitteilungen an die Anteilinhaber 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 Veränderungen des Wertpapierbestands werden den Anteilinhabern 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.

Value-at-Risk (gefährdeter Wert)
Für OGAWs kann der Value-at-Risk (VaR) auf absoluter oder relativer Basis gemessen werden. Der VaR ist ein verbreitet verwendeter Risikomaßstab für das Verlustrisiko eines bestimmten Portefeuilles an Finanzanlagen. Der Anlageverwalter hat das Gesamtrisiko (Marktrisiko) der Aktienportefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 unter Verwendung des auf relativer Basis errechneten VaR überwacht (gemäß dem der VaR des jeweiligen Portefeuilles höchstens doppelt so hoch sein darf wie der VaR der jeweiligen Vergleichsgröße). Während des besagten Geschäftsjahres lauteten die Tiefst-, Höchst- und Durchschnittswerte für den VaR der einzelnen Portefeuilles auf relativer Basis gemessen folgendermaßen:

Portefeuille	Vergleichsgröße	Tiefstwert	Höchstwert	Durchschnitt
International Health Care Portfolio	MSCI World Healthcare	85.91%	114.03%	97.14%
International Technology Portfolio	MSCI World Information Technology	84.38%	117.97%	106.22%
Global Real Estate Securities Portfolio	FTSE EPRA/NAREIT Global Real Estate Index USD	65.68%	136.83%	106.70%
Sustainable Global Thematic Portfolio	MSCI AC World	85.37%	113.28%	102.34%
India Growth Portfolio	Bombay Stock Exchange 200 Index	90.31%	122.10%	103.09%
US Small and Mid-Cap Portfolio	Russell 2500	89.77%	117.04%	101.70%
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	MSCI Emerging Markets	60.77%	100.18%	73.43%
Select US Equity Portfolio	S&P 500	93.35%	110.42%	100.72%
Low Volatility Equity Portfolio	MSCI World Unhedged	71.00%	90.11%	82.82%
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	MSCI Emerging Markets Index Cap Weighted	72.88%	89.16%	78.22%

Portefeuille	Vergleichsgröße	Tiefstwert	Höchstwert	Durchschnitt
European Equity Portfolio	MSCI Europe	83.39%	140.02%	97.46%
Eurozone Equity Portfolio	MSCI EMU	82.64%	125.90%	100.77%
American Growth Portfolio	Russell 1000 Growth	84.64%	104.37%	96.78%
All Market Income Portfolio	50% MSCI World Index / 40% Bloomberg Barclays Global High Yield (Hedged) / 10% Bloomberg Barclays Global Treasuries (Hedged)	59.67%	146.52%	81.97%
China A Shares Equity Portfolio	MSCI China A Index	81.52%	104.93%	95.62%

Für die Rentenportefeuilles hat der Anlageverwalter das Gesamtrisiko (Marktrisiko) unter Verwendung des auf absoluter Basis errechneten VaR überwacht (wonach der VaR des betreffenden Portefeuilles 20% seines Nettoinventarwerts nicht übersteigen darf). Während des besagten Geschäftsjahres lauteten die Tiefst-, Höchst- und Durchschnittswerte für den VaR der einzelnen Portefeuilles auf absoluter Basis gemessen folgendermaßen:

Portefeuille	Tiefstwert	Höchstwert	Durchschnitt
Euro High Yield Portfolio	2.58%	31.27%	5.24%
RMB Income Plus Portfolio	0.68%	5.99%	2.06%
Short Duration High Yield Portfolio	1.23%	20.33%	3.07%
Global Plus Fixed Income Portfolio	1.24%	9.41%	2.38%
Select Absolute Alpha Portfolio	6.87%	17.57%	8.56%
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	4.48%	13.64%	7.42%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	2.03%	8.32%	3.77%
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	1.72%	22.43%	4.54%
US High Yield Portfolio	1.68%	29.19%	4.47%
Global Dynamic Bond Portfolio	0.59%	10.29%	1.72%
Global Income Portfolio	1.01%	15.19%	2.26%
Alternative Risk Premia Portfolio	1.80%	14.42%	6.32%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	0.97%	20.62%	2.97%

Fremdfinanzierung
Für nachstehende Portefeuilles erwartet der Anlageverwalter, dass er keine Bankdarlehen benutzen wird, um die Anlagestrategie des Portefeuilles umzusetzen.

Das erwartete Fremdfinanzierungsniveau wird als Summe der Nominalbeträge der derivativen Finanzinstrumente berechnet, die vom Portefeuille gehalten werden. Laut CSSF-Rundschreiben 11/512 vom 30. Mai 2011 berücksichtigt diese Berechnungsmethode weder die Tatsache, dass ein bestimmtes derivatives Finanzinstrument das Anlagerisiko des Portefeuilles erhöht oder senkt, noch erlaubt sie es, derivative Finanzinstrumente mit umgekehrten Positionen zu verrechnen.

Anleger sollten sich dessen bewusst sein, dass (i) ein höheres erwartetes Fremdfinanzierungsniveau nicht automatisch ein höheres Anlagerisiko impliziert und (ii) dass das oben angegebene erwartete Fremdfinanzierungsniveau überwiegend die Verwendung von Derivaten zu Absicherungszwecken oder zum effizienten Portefeuillemanagement widerspiegelt. Darüber hinaus kann das tatsächliche Fremdfinanzierungsniveau des Portefeuilles von dem nachstehend genannten erwarteten Fremdfinanzierungsniveau abweichen:

- International Health Care Portfolio
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- International Technology Portfolio
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Global Real Estate Securities Portfolio:
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Sustainable Global Thematic Portfolio:
  0%-100% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- India Growth Portfolio:
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Euro High Yield Portfolio
  20%-250% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- US Small and Mid-Cap Portfolio
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Emerging Markets Multi-Asset Portfolio
  50%-300% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- RMB Income Plus Portfolio
  50%-300% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Short Duration High Yield Portfolio
  20%-300% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Select US Equity Portfolio
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Global Plus Fixed Income Portfolio
  0%-100% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Select Absolute Alpha Portfolio
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Emerging Market Local Currency Debt Portfolio
  20%-300% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio
  100%-350% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles

- Emerging Market Corporate Debt Portfolio
  0%-100% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- US High Yield Portfolio
  20%-100% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Low Volatility Equity Portfolio
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio
  0%-100% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Global Dynamic Bond Portfolio
  100%-200% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Global Income Portfolio
  0%-400% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Alternative Risk Premia Portfolio
  300%-1000% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- European Equity Portfolio
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Eurozone Equity Portfolio
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- American Growth Portfolio
  0%-50% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- All Market Income Portfolio
  0%-350% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- China A Shares Equity Portfolio
  0%-100% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Sustainable Global Thematic Credit Portfolio
  0%-200% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles

Infolge der Verwendung des Summe-der-Nominalbeträge-Ansatzes betrug die durchschnittliche Fremdfinanzierung der Portefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020:

Portefeuille	Fremdfinanzierung
International Health Care Portfolio	0.00%
International Technology Portfolio	0.00%
Global Real Estate Securities Portfolio	11.13%
Sustainable Global Thematic Portfolio	46.22%
India Growth Portfolio	1.13%
Euro High Yield Portfolio	22.39%
US Small and Mid-Cap Portfolio	0.00%
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	130.41%
RMB Income Plus Portfolio	126.77%
Short Duration High Yield Portfolio	37.54%
Select US Equity Portfolio	0.12%
Global Plus Fixed Income Portfolio	117.39%
Select Absolute Alpha Portfolio	3.32%
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	162.76%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	119.51%
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	14.24%
US High Yield Portfolio	28.37%
Low Volatility Equity Portfolio	21.29%
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	0.70%
Global Dynamic Bond Portfolio	211.91%
Global Income Portfolio	121.42%
Alternative Risk Premia Portfolio	345.25%
European Equity Portfolio	25.56%
Eurozone Equity Portfolio	5.99%
American Growth Portfolio	0.00%
All Market Income Portfolio	110.12%
China A Shares Equity Portfolio	0.00%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	99.28%

Für die unten aufgeführten Portefeuilles hat der Anlageverwalter den Commitment-Ansatz gemäß CSSF-Rundschreiben 11/512 vom 30. Mai 2011 angewendet, um das Gesamtrisiko (Marktrisiko) zu überwachen, das sich aus der Verwendung von derivativen Finanzinstrumenten ergibt. Folglich wird das Netto-Derivatrisiko, das aus Derivattransaktionen sowie Barmitteln und anderen Anlagen entsteht, dem NIW des Portefeuilles weitgehend entsprechen.

Infolge der Verwendung des Commitment-Ansatzes betrug die durchschnittliche Fremdfinanzierung der Portefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020:

Portefeuille	Fremdfinanzierung
Concentrated US Equity Portfolio	0.00%
Concentrated Global Equity Portfolio	6.68%
Global Core Equity Portfolio	0.00%
Financial Credit Portfolio	6.79%

Vergütung

Vom 1. Januar 2019 bis zum 31. Dezember 2019 (der „Referenzzeitraum“) belief sich der Gesamtbetrag der Vergütung, die – in Barmitteln und/oder beschränkt handelbaren Wertpapieren – von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. (die „Gesellschaft“) an ihre gesamte Belegschaft (die während des Referenzzeitraums im Durchschnitt aus 47 Mitarbeitern bestand, einschließlich ihrer Zweigniederlassung) gezahlt wurde, auf EUR 4,421,776.47.

Insbesondere war der oben genannte Gesamtbetrag der im Referenzzeitraum gezahlten Vergütung folgendermaßen in eine feste und eine variable Vergütung unterteilt:

- Feste Vergütung: EUR 3,736,408.65
- Variable Vergütung: EUR 685,367.82

Es werden keine auf der Performance des Fonds basierenden Gebühren oder Gewinnbeteiligungen für die Vergütung von Mitarbeitern der Gesellschaft verwendet.

Während des Referenzzeitraums wurde von dem Fonds und/oder der Gesellschaft keine Vergütung an die identifizierte Belegschaft des Anlageverwalters gezahlt.

Im Referenzzeitraum belief sich der Gesamtbetrag der an die identifizierte Belegschaft gezahlten Bezüge, die während

des Referenzzeitraums aus 9 Mitarbeitern bestand, auf EUR 1,551,852.38 (wie folgt aufgeteilt: feste Vergütung EUR 1,187,217.51 variable Vergütung EUR 364,634.87, was weniger als 23% der Gesamtvergütung entspricht).

Bitte beachten Sie, dass die vorstehend genannten Zahlen für alle von der Gesellschaft bereitgestellten Dienstleistungen gelten und keine Aufschlüsselung auf Fondsebene darstellen.

Detaillierte Informationen zu den finanziellen und nicht finanziellen Kriterien der Vergütungspolitik und -praxis, zum Entscheidungsfindungsprozess bei der Festlegung der Vergütungspolitik sowie zum Zusammenhang zwischen Bezahlung und Leistung sind im Vergütungsbericht auf der Website von AB Global verfügbar: www.alliancebernstein.com/go/remuneration_policy

Während des Referenzzeitraums wurde eine Überprüfung der Vergütungspolitik und ihrer Umsetzung vorgenommen, wobei keine Unregelmäßigkeiten aufgedeckt wurden. Schließlich wurde während des Referenzzeitraums keine wesentliche Änderung an der Vergütungspolitik in ihrer ursprünglich vorgesehenen Form vorgenommen.

PEA-Fähigkeit (Plan d'Epargne en Actions)

Der Plan d'Epargne en Actions („PEA") ist ein französischer Steuersparplan, der es in Frankreich ansässigen Personen ermöglicht, von bestimmten Steuerbefreiungen für Investitionen in europäische Aktien zu profitieren. Ein PEA-fähiger Fonds muss mindestens 75% seiner Vermögenswerte permanent in PEA-fähige aktienbezogene Wertpapiere (ausgenommen Wandelanleihen) von Unternehmen investieren, die in einem Mitgliedstaat der Europäischen Union oder in Island und Norwegen ansässig sind und der Körperschaftssteuer oder einer vergleichbaren Steuer unterliegen.

Im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 investierte das folgende Portfolio überwiegend in PEA-fähige aktienbezogene Wertpapiere. Der durchschnittliche tägliche Prozentsatz der Anlage in diesen Wertpapieren stellt sich wie folgt dar:

Portefeuille	Täglicher Durchschnitt (%)
Eurozone Equity Portfolio	98.09%

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 Kaufs-/Rückverkaufsgeschäft oder Verkaufs-/Rückkaufsgeschäft;

oder

- ein Margenleihgeschäft.

Während des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2020 hatte der Fonds Wertpapierleihgeschäfte und Total-Return-Swaps (TRS) abgeschlossen, die als Instrumententyp unter die SFT-Verordnung fallen.

Allgemeine Angaben

Zum 31. Mai 2020 belief sich das Vermögen über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps hinweg auf folgende Beträge:

International Technology Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	$16,124,290	2.42%	2.69%

Global Real Estate Securities Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	$147,598	0.35%	0.38%

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	$2,748,980	0.23%	0.51%

Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	$28,490,490	0.74%	0.81%

Concentrated Global Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	$16,764,154	2.70%	3.89%

Alternative Risk Premia Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	$1,443,976	3.52%	1.67%

European Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	€13,087,327	3.30%	3.52%

Eurozone Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	€54,188,697	4.40%	4.07%

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	$16,058,074	1.37%

Short Duration High Yield Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	$6,828,629	0.68%

US High Yield Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	$685,818	0.58%

Alternative Risk Premia Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	$(323,361)	(0.79)%

All Market Income Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	$2,741,951	0.22%

Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten
Während des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2020 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Während des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2020 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

Angaben zur Konzentration
Zum 31. Mai 2020 waren Folgende die zehn größten Emittenten der bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps erhaltenen Sicherheitswertpapiere:

Wertpapierleihe

International Technology Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	$9,820,885
2	Deutsche Regierung	$5,395,484
3	Niederländische Regierung	$3,936,949
4	US-Regierung	$2,719,023

Global Real Estate Securities Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	US-Regierung	$85,157
2	Deutsche Regierung	$41,924
3	Niederländische Regierung	$27,896
4	Französische Regierung	$1

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Niederländische Regierung	$1,001,342
2	US-Regierung	$810,627
3	Französische Regierung	$554,920
4	Schweizer Regierung	$481,567
5	Deutsche Regierung	$37,975

Low Volatility Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	US-Regierung	$16,197,289
2	Deutsche Regierung	$7,974,194
3	Niederländische Regierung	$5,305,964
4	Französische Regierung	$355,566
5	Regierung des Vereinigten Königreichs	$152,719

Concentrated Global Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	$13,551,269
2	Regierung des Vereinigten Königreichs	$3,749,241
3	Deutsche Regierung	$2,897,038
4	Niederländische Regierung	$1,843,603
5	US-Regierung	$674,176

Alternative Risk Premia Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	$1,039,317
2	Deutsche Regierung	$660,172
3	US-Regierung	$565,449
4	Niederländische Regierung	$497,172

European Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Regierung des Vereinigten Königreichs	€6,548,391
2	Französische Regierung	€4,836,277
3	Niederländische Regierung	€2,356,849
4	US-Regierung	€180

Eurozone Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	€32,265,792
2	Regierung des Vereinigten Königreichs	€12,028,348
3	US-Regierung	€5,942,950
4	Niederländische Regierung	€3,796,966
5	Deutsche Regierung	€3,760,660

Total-Return-Swaps

Zum 31. Mai 2020 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

Zum 31. Mai 2020 waren Folgende die zehn größten Gegenparteien bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps:

International Technology Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	$9,191,605
	2	UBS AG	$6,932,685

Global Real Estate Securities Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	$147,598

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	JPMorgan Chase	$2,549,558
	2	Citigroup Global Markets Limited	$193,281
	3	Merrill Lynch	$6,141

Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	$28,073,970
	2	Morgan Stanley	$416,520

Concentrated Global Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Morgan Stanley	$10,225,531
	2	UBS AG	$4,737,296
	3	Citigroup Global Markets Limited	$1,298,666
	4	Merrill Lynch	$502,661

Alternative Risk Premia Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	$713,251
	2	UBS AG	$622,978
	3	Merrill Lynch	$107,747

European Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Societe Generale	€6,851,547
	2	Credit Suisse	€6,235,780

Eurozone Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Societe Generale	€34,098,669
	2	Citigroup Global Markets Limited	€20,090,028

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Goldman Sachs	$16,058,074

Short Duration High Yield Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	JPMorgan Chase	$9,602,980
	2	Barclays	$(2,774,351)

US High Yield Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	JPMorgan Chase	$856,134
	2	Barclays	$(170,316)

Alternative Risk Premia Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Morgan Stanley	$89,960
	2	Bank of America	$83,469
	3	Credit Suisse	$26,097
	4	JPMorgan Chase	$(124,216)
	5	Goldman Sachs	$(398,671)

All Market Income Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	JPMorgan Chase	$2,341,586
	2	Goldman Sachs	$400,365

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapierleihe

Zum 31. Mai 2020 hielten vier Depotbanken die folgenden erhaltenen Sicherheiten:

International Technology Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Clearstream	Wertpapiersicherheit	$12,221,155
Euroclear	Wertpapiersicherheit	$6,932,163
US-Notenbank	Wertpapiersicherheit	$2,719,023

Global Real Estate Securities Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
US-Notenbank	Wertpapiersicherheit	$85,157
Euroclear	Wertpapiersicherheit	$69,821

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	$2,075,804
US-Notenbank	Wertpapiersicherheit	$810,627

Low Volatility Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
US-Notenbank	Wertpapiersicherheit	$16,197,289
Euroclear	Wertpapiersicherheit	$13,788,443

Concentrated Global Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	$13,690,095
Clearstream	Wertpapiersicherheit	$8,351,056
US-Notenbank	Wertpapiersicherheit	$674,176

Alternative Risk Premia Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	$1,098,456
Clearstream	Wertpapiersicherheit	$1,098,205
US-Notenbank	Wertpapiersicherheit	$565,449

European Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	€9,548,555
CREST	Wertpapiersicherheit	€4,192,962
US-Notenbank	Wertpapiersicherheit	€180

Eurozone Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	€51,839,432
US-Notenbank	Wertpapiersicherheit	€5,942,950
CREST	Wertpapiersicherheit	€12,334

Total-Return-Swaps

Zum 31. Mai 2020 hielt eine Depotbank die folgenden erhaltenen Sicherheiten:

Short Duration High Yield Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag*
Brown Brothers Harriman	Barsicherheit	$9,222,550

Alternative Risk Premia Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag*
Brown Brothers Harriman	Barsicherheit	$7,000

*Ein Teil der Sicherheit bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

Verwahrung der gewährten Sicherheiten

Total-Return-Swaps

Zum 31. Mai 2020 beläuft sich Anteil der Sicherheiten, der in separaten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wird, auf Folgendes:

Short Duration High Yield Portfolio

	%
Separate Konten	0%
Gepoolte Konten	0%
Sonstige	100%

Alternative Risk Premia Portfolio

	%
Separate Konten	0%
Gepoolte Konten	0%
Sonstige	100%

All Market Income Portfolio

	%
Separate Konten	0%
Gepoolte Konten	0%
Sonstige	100%

Erträge/Kosten

Im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2020 belaufen sich die Erträge und Kosten für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total-Return-Swaps auf Folgendes:

Wertpapierleihe

International Health Care Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$95,431	80%
Für dritte Partei	$23,858	20%

International Technology Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$250,797	80%
Für dritte Partei	$62,699	20%

Global Real Estate Securities Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$113	80%
Für dritte Partei	$28	20%

Sustainable Global Thematic Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$36,098	80%
Für dritte Partei	$9,025	20%

US Small and Mid-Cap Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$523	80%
Für dritte Partei	$131	20%

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$201,939	80%
Für dritte Partei	$50,485	20%

Select US Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$591	80%
Für dritte Partei	$148	20%

Select Absolute Alpha Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$39	80%
Für dritte Partei	$10	20%

Low Volatility Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$499,991	80%
Für dritte Partei	$124,998	20%

Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$35,999	80%
Für dritte Partei	$9,000	20%

Concentrated US Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$103,107	80%
Für dritte Partei	$25,777	20%

Concentrated Global Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$94,836	80%
Für dritte Partei	$23,709	20%

Global Core Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$77,361	80%
Für dritte Partei	$19,340	20%

Alternative Risk Premia Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$14,111	80%
Für dritte Partei	$3,528	20%

European Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	€187,885	80%
Für dritte Partei	€46,971	20%

Eurozone Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	€328,211	80%
Für dritte Partei	€82,053	20%

American Growth Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	$1,028	80%
Für dritte Partei	$257	20%

Total-Return-Swaps

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$61,718,250	100%

Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$45,029,963	100%

Short Duration High Yield Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$7,917,760	100%

Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$2,577,396	100%

US High Yield Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$688,998	100%

Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$19,993	100%

Alternative Risk Premia Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$18,177,643	100%

Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$25,400,056	100%

All Market Income Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$17,573,211	100%

Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	$27,798,274	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 Portefeuille zu und unterliegen keinen Gewinnaufteilungsvereinbarungen.

Zusammenfassende Transaktionsangaben

Zum 31. Mai 2020 besitzen die verschiedenen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Returns-Swaps folgende Fälligkeiten:

Wertpapierleihe

International Technology 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
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$16,124,290

Global Real Estate Securities 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
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$147,598

Emerging Markets Multi-Asset 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
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$2,748,980

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
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$28,490,490

Concentrated Global 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
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$16,764,154

Alternative Risk Premia 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
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$1,443,976

European 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
Über ein Jahr	€0
Offene Fälligkeit	€13,087,327

Eurozone 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
Über ein Jahr	€0
Offene Fälligkeit	€54,188,697

Total-Return-Swaps

Emerging Markets Multi-Asset 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	$16,058,074
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$0

Short Duration High Yield Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	$0
Ein Tag bis eine Woche	$0
Eine Woche bis ein Monat	$7,725,063
Ein bis drei Monate	$0
Drei Monate bis ein Jahr	$(896,434)
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$0

US High Yield Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	$0
Ein Tag bis eine Woche	$0
Eine Woche bis ein Monat	$856,134
Ein bis drei Monate	$0
Drei Monate bis ein Jahr	$(170,316)
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$0

Alternative Risk Premia Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	$0
Ein Tag bis eine Woche	$0
Eine Woche bis ein Monat	$(272,456)
Ein bis drei Monate	$80,916
Drei Monate bis ein Jahr	$(131,821)
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$0

All Market Income Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	$1,577,475
Ein Tag bis eine Woche	$0
Eine Woche bis ein Monat	$0
Ein bis drei Monate	$0
Drei Monate bis ein Jahr	$1,164,476
Über ein Jahr	$0
Offene Fälligkeit	$0

Zum 31. Mai 2020 kommen folgende Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps zum Einsatz:

Wertpapierleihe

International Technology Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	$16,124,290

Global Real Estate Securities Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	$147,598

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	$2,748,980

Low Volatility Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	$28,490,490

Concentrated Global Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	$16,764,154

Alternative Risk Premia Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	$1,443,976

European Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	€13,087,327

Eurozone Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	€54,188,697

Total-Return-Swaps

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	$16,058,074

Short Duration High Yield Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	$6,828,629

US High Yield Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	$685,818

Alternative Risk Premia Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	$(323,361)

All Market Income Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	$2,741,951

Die zusammenfassenden Transaktionsangaben für Sicherheitspositionen (einschließlich Barmittel), die zum 31. Mai 2020 für sämtliche Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps erhalten wurden, lauten folgendermaßen:

Wertpapierleihe

International Technology Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 25/07/2024	$2,199,804	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 25/11/2026	$2,199,799	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 15/01/2022	$2,199,758	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/01/2024	$2,199,558	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 25/04/2022	$1,737,198	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/11/2029	$1,737,194	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 15/01/2022	$1,737,191	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2029	$1,581,051	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 2.50%, 04/01/2021	$1,475,346	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/09/2024	$1,470,402	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 1.85%, 25/07/2027	$1,386,080	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 15/05/2024	$1,248,621	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.25%, 25/05/2024	$560,810	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/10/2022	$106,309	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2026	$33,220	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Global Real Estate Securities Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 14/04/2023	$27,896	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 7.50%, 15/01/2023	$27,896	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 31/01/2026	$22,989	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 31/03/2023	$22,001	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 31/03/2024	$21,180	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/06/2022	$18,981	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 04/07/2028	$14,028	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 15/11/2021	$6	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 5.50%, 25/04/2029	$1	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 1.75%, 15/07/2023	$481,864	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 25/11/2028	$481,860	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 15/02/2029	$481,820	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 0.75%, 15/07/2027	$481,787	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	Schweizer Staatsanleihe 1.50%, 24/07/2025	$481,567	AAA	>1 Jahr	CHF	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 31/01/2024	$268,089	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 25/04/2022	$36,530	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 15/01/2022	$36,530	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/11/2029	$36,530	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2029	$33,246	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/09/2024	$30,920	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 15/05/2024	$26,256	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/10/2022	$2,235	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 14/04/2023	$1,161	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 7.50%, 15/01/2023	$1,161	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 31/01/2026	$956	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 31/03/2023	$915	AA+	>1 Jahr	$	Schweiz
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 31/03/2024	$881	AA+	>1 Jahr	$	Schweiz
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/06/2022	$790	AA+	>1 Jahr	$	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2026	$699	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 04/07/2028	$584	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/09/2021	$50	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Low Volatility Equity Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 7.50%, 15/01/2023	$5,305,964	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 14/04/2023	$5,305,889	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 31/01/2026	$4,372,435	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 31/03/2023	$4,184,745	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 31/03/2024	$4,028,564	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/06/2022	$3,610,347	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 04/07/2028	$2,668,294	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 22/03/2026	$91,451	AA	>1 Jahr	£	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 5.50%, 25/04/2029	$91,451	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 0.50%, 25/05/2026	$91,451	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 2.25%, 25/10/2022	$91,448	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/11/2029	$80,993	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.63%, 22/10/2028	$61,268	AA	>1 Jahr	£	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 15/11/2021	$1,198	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 5.50%, 25/04/2029	$103	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.75%, 25/10/2027	$84	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 3.25%, 25/10/2021	$36	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 04/01/2030	$11	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Concentrated Global Equity Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 5.50%, 25/04/2029	$2,245,117	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 22/03/2026	$2,245,117	AA	>1 Jahr	£	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 0.50%, 25/05/2026	$2,245,116	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 2.25%, 25/10/2022	$2,245,029	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/11/2029	$1,988,374	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.63%, 22/10/2028	$1,504,122	AA	>1 Jahr	£	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 25/07/2024	$1,503,189	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 25/11/2026	$1,503,184	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 15/01/2022	$1,503,155	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/01/2024	$1,503,019	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 2.50%, 04/01/2021	$1,008,145	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 1.85%, 25/07/2027	$947,147	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.25%, 25/05/2024	$383,217	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 25/04/2022	$245,446	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 15/01/2022	$245,445	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/11/2029	$245,445	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2029	$223,384	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/09/2024	$207,750	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 15/05/2024	$176,416	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 7.50%, 15/01/2023	$95,003	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 14/04/2023	$95,001	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 31/01/2026	$78,288	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 31/03/2023	$74,927	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 31/03/2024	$72,131	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/06/2022	$64,643	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 04/07/2028	$47,775	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/10/2022	$15,020	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2026	$4,694	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 15/11/2021	$21	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 22/03/2029	$2	AA	>1 Jahr	£	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 5.50%, 25/04/2029	$2	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.75%, 25/10/2027	$2	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 3.25%, 25/10/2021	$1	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Alternative Risk Premia Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 25/04/2022	$234,507	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 15/01/2022	$234,506	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/11/2029	$234,506	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2029	$213,429	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/09/2024	$198,491	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 25/07/2024	$197,677	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 25/11/2026	$197,676	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 15/01/2022	$197,672	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/01/2024	$197,654	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 15/05/2024	$168,553	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 2.50%, 04/01/2021	$132,576	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 1.85%, 25/07/2027	$124,554	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 7.50%, 15/01/2023	$64,994	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 14/04/2023	$64,993	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 31/01/2026	$53,559	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 31/03/2023	$51,260	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.25%, 25/05/2024	$50,395	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 31/03/2024	$49,347	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/06/2022	$44,224	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 4.75%, 04/07/2028	$32,685	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/10/2022	$14,351	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2026	$4,484	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	US-amerikanische Schatzanweisung 2.88%, 15/11/2021	$15	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 5.50%, 25/04/2029	$1	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.75%, 25/10/2027	$1	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

European Equity Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 4.25%, 25/10/2023	€1,294,929	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 17/06/2020	€1,294,924	AA	Weniger als ein Monat	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.50%, 22/01/2021	€1,180,480	AA	3 Monate bis 1 Jahr	£	Frankreich
Credit Suisse	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.75%, 07/09/2022	€1,178,536	AA	>1 Jahr	£	Schweiz
Credit Suisse	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 22/03/2024	€1,178,531	AA	>1 Jahr	£	Schweiz
Credit Suisse	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.88%, 22/10/2029	€1,178,474	AA	>1 Jahr	£	Schweiz
Credit Suisse	Niederländische Staatsanleihe 0.50%, 15/07/2026	€1,178,427	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Niederländische Staatsanleihe 1.75%, 15/07/2023	€1,178,422	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.25%, 22/07/2027	€1,174,948	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 23/09/2020	€1,024,386	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/03/2024	€883,940	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Credit Suisse	Britische Staatsanleihe (Gilt) 2.50%, 17/07/2024	€655,004	AA	>1 Jahr	£	Schweiz
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/02/2023	€338,098	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 5.00%, 07/03/2025	€2,418	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Credit Suisse	US-amerikanische Schatzanweisung 0.00%, 09/07/2020	€180	AA+	1 Monat bis 3 Monate	$	Schweiz

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Eurozone Equity Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 4.25%, 25/10/2023	€6,605,963	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 17/06/2020	€6,605,941	AA	Weniger als ein Monat	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.50%, 22/01/2021	€6,022,120	AA	3 Monate bis 1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.25%, 22/07/2027	€5,993,894	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 23/09/2020	€5,225,815	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/03/2024	€4,509,342	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 25/04/2022	€3,796,981	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/11/2029	€3,796,972	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 15/01/2022	€3,796,966	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2029	€3,455,692	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 30/09/2024	€3,213,848	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.50%, 15/05/2024	€2,729,102	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 25/02/2023	€1,724,778	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/10/2022	€232,358	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 15/08/2026	€72,610	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 5.00%, 07/03/2025	€12,334	AA	>1 Jahr	£	Frankreich

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Total-Return-Swaps

Short Duration High Yield Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag*	Qualität**	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
JPMorgan Chase	Barmittel	$9,222,550	N/A	N/A	€	Vereinigte Staaten

* Ein Teil der Sicherheit bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

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

Alternative Risk Premia Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag*	Qualität**	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Credit Suisse	Barmittel	$7,000	N/A	N/A	$	Schweiz

* Ein Teil der Sicherheit bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

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

Die gesamten Transaktionsdaten aller im Rahmen von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total-Return-Swaps gewährten Sicherheitenpositionen (einschließlich Barmitteln) zum 31. Mai 2020 sind nachstehend aufgeführt:

Total-Return-Swaps

Short Duration High Yield Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag*	Qualität**	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Barclays	Barmittel	$2,400,000	N/A	N/A	$	Großbritannien

* Ein Teil der Sicherheit bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

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

Alternative Risk Premia Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag*	Qualität**	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Bank of America	US-Schatzwechsel, 0.00%, 06/11/2020	$690,976	AA+	1 Woche bis 1 Monat	$	Vereinigte Staaten
Goldman Sachs	US-Schatzwechsel, 0.00%, 06/11/2020	$4,999,827	AA+	1 Woche bis 1 Monat	$	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	US-Schatzwechsel, 0.00%, 10/22/2020	$1,528,897	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	US-Schatzwechsel, 0.00%, 06/11/2020	$651,077	AA+	1 Woche bis 1 Monat	$	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Barmittel	$583,000	N/A	N/A	$	Vereinigte Staaten

* Ein Teil der Sicherheit bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

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

All Market Income Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag*	Qualität**	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Goldman Sachs	US-Schatzanweisung, 1.625%, 08/15/2029	$5,438,805	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	US-Schatztitel (per Emission), 2.625%, 02/15/2029	$4,309,462	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	US-Schatzanweisung, 1.625%, 08/15/2029	$5,152,310	AA+	>1 Jahr	$	Vereinigte Staaten

* Ein Teil der Sicherheit bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

** 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 DES FONDS	**Bertrand Reimmel** **Louis Mangan** (bis 28. Juni 2019) **Silvio Cruz** **Yves Prussen** (bis 13. Januar 2020) **Scott Parkin** (seit 26. Juli 2019) **Olivia Moessner** (seit 31. Oktober 2019) **Susanne van Dootingh** (seit 14. Januar 2020)
VERWALTUNGSRAT DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT	**Bertrand Reimmel** **Louis Mangan** (bis 28. Juni 2019) **Silvio Cruz** **Simone Thelen** (bis 30. April 2020) **Yves Prussen** **Steven Eisenberg** **Mark Manley** (seit 7. August 2019)
ANLAGEVERWALTER*	**AllianceBernstein L.P.** 1345 Avenue of the Americas New York, New York 10105 Vereinigte Staaten von Amerika
VERWALTUNGSSTELLE* UND DEPOTBANK	**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

* Beauftragt von der Verwaltungsgesellschaft.

RECHTSBERATER	*In Indien*	**AZB & Partners** AZB House Peninsula Corporate Park Ganpatrao Kadam Marg Lower Parel Mumbai 400 013 Indien
	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 40th Floor 100 Oliver Street Boston, MA 02110-2605 Vereinigte Staaten von Amerika
INDISCHE KORRESPONDENZBANK		**Citibank, NA** Financial Institutions Group Nariman Point 230 Backbay Reclamation Mumbai 400 021 Indien
FACILITIES AGENT IM VEREINIGTEN KÖNIGREICH		**AllianceBernstein Limited** 50 Berkeley Street London W1J 8HA Großbritannien

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

AllianceBernstein®

ASCV-SRA-GR-SZ-0520