


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
- + 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
- + Low Volatility Total Return 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
- + Event Driven Portfolio
- + Arya European Alpha Portfolio

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 2021 sind folgende Portefeuilles des Fonds in Hongkong nicht zugelassen und können den Einwohnern von Hongkong nicht angeboten werden: Select Absolute Alpha Portfolio, Alternative Risk Premia Portfolio, Financial Credit Portfolio, Sustainable Global Thematic Credit Portfolio, Event Driven Portfolio und Arya European Alpha Portfolio.

	Seite
Bericht des Verwaltungsrats	1
Brief an die Anteilinhaber	4
Wertentwicklung der Anteile	5
Verzeichnis der Anlagewerte	22
Zusammensetzung des Fondsvermögens	260
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens	268
Umlaufende Anteile	276
Statistische Informationen	290
Anmerkungen zum Jahresabschluss	317
Tabelle 1– Gebührenstruktur	350
Tabelle 2 – Portefeuilleumsatz	371
Bericht des unabhängigen Wirtschaftsprüfers	372
Informationen für die Anteilinhaber (ungeprüft)	374

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

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 ist Herr Reimmel für die Bereiche Recht, Investment Compliance, Risikomanagement, Humankapital und Corporate Accounting zuständig. 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 Dootinh – Mitglied des Verwaltungsrats seit Januar 2020

Susanne van Dootinh 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 51 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, Irland, 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:

- **Silvio Cruz**, Vorsitzender/Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied
- **Bertrand Reimmel**, Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied
- **Scott Parkin**, Geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied
- **Susanne van Dootinh**, Unabhängiges Verwaltungsratsmitglied
- **Olivia Moessner**, Nicht-geschäftsführendes Verwaltungsratsmitglied

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.

c. 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 Bedingungen 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

Der Verwaltungsrat tritt vierteljährlich zusammen, in der Regel im Januar, April, Juli und Oktober. Bei Bedarf werden jedoch Ad-hoc-Sitzungen einberufen.

Während des Geschäftsjahres des Fonds fanden vier vierteljährliche Verwaltungsratssitzungen sowie zwei Ad-hoc-Verwaltungsratssitzungen im September 2020 und Februar 2021 statt.

Ereignisse während des Geschäftsjahres

- Der Verwaltungsrat beschloss, die Zusammenlegung aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des AB Arya ICAV – European Alpha Portfolio, eines dem irischen Recht unterliegenden Organismus zur gemeinsamen Anlage in übertragbare Wertpapiere, mit dem AB SICAV I – Arya European Alpha Portfolio zu genehmigen. Die Zusammenlegung trat zum 28. Januar 2021 in einem Verhältnis von 1:1 in Kraft.
- Der Verwaltungsrat beschloss, die Auflegung des folgenden neuen Portefeuilles innerhalb des Fonds zu genehmigen: Arya European Alpha Portfolio. Das Portefeuille nahm seine Geschäftstätigkeit am 7. Oktober 2020 auf.

COVID 19

Ab Ende 2019 und bis ins Jahr 2021 hinein weitete sich der Ausbruch des neuen Coronavirus, das eine als COVID-19 bekannte Krankheit verursacht, zu einer globalen Pandemie aus. Die zunehmenden Turbulenzen aufgrund der Ausbreitung des Coronavirus und das Potenzial für dauerhafte und erhebliche negative Auswirkungen auf die Weltwirtschaft haben zu einer erhöhten Marktvolatilität geführt, die sich im weiteren Verlauf der Pandemie und ihrer Folgen wiederholen kann. Der Verwaltungsrat wird die Entwicklung der Lage und ihre Auswirkung auf die finanzielle Situation des Fonds weiter überwachen und die operativen Pläne entsprechend anpassen, wenn die Situation dies erfordert.

21. Juni 2021

Sehr geehrte Anteilhaber,

der vorliegende Bericht bietet Ihnen eine aktuelle Übersicht über AB SICAV I (der „Fonds“) für den Jahresberichtszeitraum zum 31. Mai 2021.

Die weltweiten Aktien verzeichneten für den 12-monatigen Berichtszeitraum zum 31. Mai 2021 außergewöhnliche zweistellige Erträge, die die durch COVID-19 ausgelösten starken Verluste ausglich und die Gewinne über das Vorkrisenniveau hinaus ansteigen ließen. Die Weltwirtschaft erholte sich von den Rekordrückgängen des BIP, nachdem die Zentralbanken und Regierungen umfangreiche geld- und fiskalpolitische Maßnahmen ergriffen hatten. Auch umfangreiche Konjunkturprogramme in den USA unter Präsident Biden, die weltweit zunehmende Verteilung von Impfstoffen und die Lockerung von Beschränkungen begünstigten die weltweite Konjunkturerholung.

Gegen Ende des Berichtszeitraums wurden die Märkte wieder volatil, da Inflationsängste einen Anstieg der längerfristigen Zinssätze auslösten, was die Bewertungen vieler marktführender Wachstumswerte unter Druck setzte und eine Rotation hin zu zyklischen und wertorientierten Aktien förderte. Trotz der Besorgnis über eine möglicherweise zu stark stimulierte Wirtschaft blieben die Inflationsdaten verhalten und die Erträge gingen zurück, wodurch die Rotation in Richtung Value-Aktien erleichtert und die Volatilität gedämpft wurde. Small-Cap-Aktien entwickelten sich im Vergleich zu Large-Cap-Aktien deutlich besser, und in Zeiten der Marktrotation übertrafen wertorientierte Aktien ihre wachstumsorientierten Pendanten.

Die Erträge der Rentenmärkte waren uneinheitlich und wiesen eine erhöhte Volatilität und Streuung zwischen Regionen und Kreditsektoren auf. Die Erträge längerfristiger Staatsanleihen stiegen im August aufgrund der Erwartung einer Erholung des Wirtschaftswachstums stetig an. Die historisch niedrigen Zinssätze waren auch der Grund für einen starken Anstieg der Risikoanlagen.

Hochverzinsliche Staats- und Unternehmensanleihen aus Schwellenländern sowie hochverzinsliche Unternehmensanleihen aus Industrieländern führten zu beträchtlichen Gewinnen, da Anleger auf der Suche nach höheren Erträgen waren. Investment-Grade-Staatsanleihen aus Schwellenländern sowie Unternehmensanleihen aus Schwellen- und Industrieländern erzielten ebenfalls starke relative Ergebnisse. Auf Lokalwährung lautende Schwellenländeranleihen schnitten besser ab, da der US-Dollar gegenüber den meisten Währungen der Schwellenländer und allen wichtigen Währungen der Industrieländer (mit Ausnahme des Yen) fiel.

Die Brent-Rohölpreise erholten sich aufgrund der positiven globalen Wirtschaftsaussichten und der Produktionskürzungen der OPEC+ deutlich, wohingegen Kupfer stark anstieg, was zum Teil auf die gestiegene Nachfrage nach Infrastruktur und Initiativen für erneuerbare Energien zurückzuführen ist.

Wir danken Ihnen für Ihre Anlage in den Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

AllianceBernstein L.P., der Anlageverwalter des Fonds

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>International Health Care Portfolio</u>				
Klasse				
A	11.45%	20.37%	23.06%	689.67%
A EUR H	10.79%	18.98%	19.25%	34.13%
AD	11.43%	20.36%	23.02%	38.09%
AX	11.73%	20.97%	23.68%	5523.10%
B	10.90%	19.18%	21.84%	510.66%
BX	11.73%	20.97%	23.68%	883.38%
C	11.20%	19.82%	22.51%	204.75%
ED	10.86%	19.13%	21.71%	50.60%
I	11.89%	21.33%	24.05%	404.41%
I GBP	5.03%	5.57%	–	23.80%
S1	12.00%	21.56%	24.44%	98.60%
S14 GBP	5.37%	6.11%	–	21.68%
<u>International Technology Portfolio</u>				
Klasse				
A	10.81%	57.50%	35.36%	1081.82%
A AUD H	3.20%(1)	–	–	3.20%
A PLN H	10.14%	54.87%	32.46%	92.30%
B	10.27%	55.95%	34.02%	813.81%
C	10.56%	56.79%	34.77%	167.04%
E	10.23%	55.92%	33.97%	105.40%
I	11.25%	58.76%	36.45%	9310.00%
S1	11.38%	59.16%	36.99%	323.22%
<u>Global Real Estate Securities Portfolio</u>				
Klasse				
A	18.38%	34.91%	-15.15%	238.34%
AD	18.36%	34.99%	-15.19%	46.68%
AD AUD H	17.90%	32.98%	-19.89%	41.30%
AD NZD H	18.09%	33.27%	-18.47%	47.85%
AD SGD H	18.30%	34.33%	-16.73%	40.31%
B	17.87%	33.65%	-16.04%	165.21%
BD	17.77%	33.53%	-16.03%	35.69%
C	18.16%	34.38%	-15.57%	54.00%
I	18.90%	36.03%	-14.50%	310.86%
ID	18.85%	35.97%	-14.46%	38.24%
S1	19.18%	36.65%	-14.12%	83.93%
<u>Sustainable Global Thematic Portfolio</u>				
Klasse				
A	12.71%	44.88%	16.30%	322.90%
A AUD H	12.32%	43.36%	11.70%	234.80%
A CAD H	7.33%(2)	–	–	7.33%
A EUR H	11.99%	42.75%	12.80%	119.73%
A SGD H	12.62%	44.30%	14.70%	123.67%
AN	12.70%	44.85%	16.31%	191.00%
AX	12.71%	44.86%	16.32%	677.73%
AXX	13.00%	45.60%	16.91%	1313.60%
B	12.13%	43.41%	15.17%	230.00%
BX	12.15%	43.44%	15.17%	503.66%
BXX	13.00%	45.60%	16.90%	1108.20%
C	12.46%	44.22%	15.81%	176.13%
CX	12.46%	44.22%	15.81%	140.66%
E	2.60%(3)	–	–	2.60%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Sustainable Global Thematic Portfolio (Fortsetzung)</u>				
Klasse				
E AUD H.....	0.73%(4)	—	—	0.73%
I.....	13.18%	46.03%	17.94%	416.80%
I AUD.....	6.13%(5)	—	—	6.13%
I AUD H.....	1.33%(6)	—	—	1.33%
I EUR H.....	12.47%	43.97%	13.81%	138.13%
IN.....	13.18%	46.05%	17.26%	218.74%
IX.....	13.16%	46.03%	17.26%	504.57%
S.....	13.75%	47.56%	18.54%	267.34%
S GBP.....	6.84%	28.41%	21.38%	185.33%
S1.....	13.34%	46.51%	17.76%	238.74%
S1 AUD.....	4.18%(7)	—	—	4.18%
S1 AUD H.....	2.70%(8)	—	—	2.70%
S1 JPY.....	14.99%(9)	—	—	14.99%
S1X.....	13.35%	46.53%	17.74%	288.74%
SD.....	13.75%	47.56%	18.57%	167.41%
SX.....	13.75%	47.56%	18.57%	202.29%

India Growth Portfolio

Klasse				
A.....	20.62%	68.39%	-29.86%	106.29%
A PLN H.....	20.19%	66.53%	-31.18%	12.09%
A SGD H.....	20.52%	67.72%	-30.89%	41.33%
AD AUD H.....	20.18%	66.51%	-32.79%	25.15%
AX.....	20.74%	68.73%	-29.70%	1752.10%
B.....	20.02%	66.72%	-30.56%	92.83%
BX.....	20.15%	67.06%	-30.42%	1312.20%
C.....	20.34%	67.60%	-30.17%	79.99%
I.....	21.10%	69.73%	-29.29%	2816.52%
S.....	21.84%	71.78%	-28.49%	38.00%
S1.....	21.22%	70.07%	-29.16%	44.33%

Euro High Yield Portfolio

Klasse				
A.....	3.00%	13.18%	-2.65%	85.19%
A2.....	2.99%	13.20%	-2.65%	85.80%
A2 CHF H.....	2.84%	13.09%	-2.97%	23.27%
A2 PLN H.....	3.26%	13.66%	-1.91%	10.11%
A2 USD H.....	3.54%	14.63%	0.11%	34.73%
AA.....	3.03%	13.16%	-2.63%	27.67%
AA AUD H.....	3.20%	13.51%	-3.95%	43.24%
AA HKD H.....	3.46%	14.50%	0.13%	35.83%
AA RMB H.....	4.60%	16.78%	0.33%	51.36%
AA SGD H.....	3.54%	14.31%	-1.18%	36.11%
AA USD H.....	3.43%	14.50%	0.12%	40.88%
AR.....	2.99%	13.25%	-2.67%	21.68%
AT.....	3.00%	13.23%	-2.69%	85.77%
AT AUD H.....	3.29%	13.59%	-3.73%	36.80%
AT SGD H.....	3.51%	14.33%	-1.20%	36.12%
AT USD H.....	3.55%	14.64%	0.05%	41.27%
B2.....	2.51%	12.10%	-3.60%	66.13%
C.....	2.79%	12.69%	-3.08%	76.14%
C2.....	2.79%	12.75%	-3.05%	76.87%
CT USD H.....	3.27%	14.13%	-0.43%	36.38%
I.....	3.28%	13.81%	-2.09%	96.89%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Euro High Yield Portfolio (Fortsetzung)</u>				
Klasse				
I2	3.28%	13.83%	-2.11%	97.53%
I2 CHF H	3.11%	13.71%	-2.48%	28.27%
I2 GBP H	3.65%	14.62%	-2.55%	28.60%
I2 USD H	3.79%	15.23%	0.59%	44.27%
IT USD H	3.82%	15.16%	0.72%	46.49%
NT USD H	3.33%	14.08%	-0.35%	36.83%
S	3.67%	14.73%	-1.25%	116.60%
S1	3.37%	14.07%	-1.84%	102.67%
S1 USD H	3.94%	15.49%	0.88%	49.60%
<u>US Small and Mid-Cap Portfolio</u>				
Klasse				
A	38.52%	75.93%	-15.61%	211.40%
A AUD H	37.53%	72.13%	—	61.00%
A EUR H	37.59%	72.92%	-18.91%	184.73%
C	38.22%	75.14%	-15.96%	196.33%
C EUR H	37.30%	72.18%	-19.26%	171.93%
I	39.05%	77.29%	-14.90%	240.87%
I EUR H	38.15%	74.29%	-18.26%	210.00%
S	39.81%	79.20%	-13.99%	282.54%
S EUR H	38.81%	76.11%	-17.40%	247.87%
S1	39.29%	77.87%	-14.64%	251.94%
S1 EUR H	38.34%	74.84%	-18.00%	220.67%
<u>Emerging Markets Multi-Asset Portfolio</u>				
Klasse				
A	12.42%	38.12%	-3.63%	32.13%
A AUD H	11.86%	36.19%	-7.23%	50.27%
A CAD H	12.17%	37.10%	-5.72%	43.13%
A CHF H	11.54%	35.71%	-6.88%	8.93%
A EUR H	11.70%	35.78%	-6.57%	13.33%
A GBP H	12.17%	36.89%	-6.51%	20.47%
A SGD H	12.33%	37.60%	-4.95%	42.73%
AD	12.44%	38.18%	-3.65%	43.06%
AD AUD H	11.81%	36.15%	-7.13%	40.11%
AD CAD H	12.10%	37.03%	-5.71%	33.86%
AD EUR H	11.68%	35.88%	-6.56%	24.65%
AD GBP H	12.06%	36.86%	-6.49%	31.22%
AD RMB H	13.49%	40.64%	-3.74%	28.79%
AD SGD H	12.34%	37.60%	-4.92%	43.28%
AD ZAR H	14.83%	43.06%	-1.46%	109.46%
AR	12.46%	38.20%	-3.67%	42.14%
AR EUR H	11.73%	35.90%	-6.56%	28.88%
B	11.91%	36.71%	-4.58%	19.67%
BD	11.94%	36.78%	-4.60%	31.85%
C	12.19%	37.49%	-4.04%	26.40%
ED	11.93%	36.84%	-4.61%	18.31%
ED AUD H	11.36%	34.90%	—	16.89%
ED ZAR H	14.29%	41.70%	—	30.87%
I	12.91%	39.22%	-2.83%	43.40%
I CHF H	11.94%	36.77%	-6.12%	17.53%
I EUR H	12.20%	36.99%	-5.86%	23.20%
I GBP	6.07%	21.23%	—	13.07%
I GBP H	12.56%	37.99%	-5.79%	30.27%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Emerging Markets Multi-Asset Portfolio (Fortsetzung)</u>				
Klasse				
ID	13.02%	39.38%	-2.90%	62.81%
ID GBP H	12.58%	38.01%	-5.70%	17.95%
N	12.24%	37.59%	-4.12%	34.47%
S	13.45%	40.55%	-1.92%	58.07%
S GBP H	13.08%	39.22%	-4.85%	60.20%
S1	13.01%	39.43%	-2.73%	45.93%
S1 JPY	18.89%	42.04%	-3.19%	25.73%
S1 JPY H	12.62%	38.50%	-4.98%	17.59%
S1D	13.01%	39.50%	-2.69%	23.97%
SD	13.46%	40.56%	-1.95%	75.60%
<u>RMB Income Plus Portfolio</u>				
Klasse				
A2	1.94%	3.99%	2.46%	45.34%
AR EUR	3.55%	6.96%	-0.63%	14.72%
AT	1.93%	3.98%	2.46%	45.36%
C2	1.70%	3.51%	2.01%	39.03%
CT	1.71%	3.52%	2.00%	39.19%
I2	2.22%	4.55%	3.02%	53.58%
IT	2.22%	4.55%	3.02%	53.85%
S	2.55%	5.26%	3.77%	65.05%
S1	2.28%	4.69%	3.21%	56.17%
W2	2.30%	4.74%	3.19%	14.75%
<u>Short Duration High Yield Portfolio</u>				
Klasse				
A2	3.41%	11.48%	1.05%	49.60%
A2 CHF H	2.77%	10.03%	-2.28%	16.33%
A2 EUR H	2.91%	10.17%	-1.86%	32.13%
A2 GBP H	3.16%	10.87%	-1.67%	39.40%
AA	3.42%	11.48%	1.07%	30.23%
AA AUD H	3.14%	10.80%	-1.77%	32.07%
AA SGD H	3.39%	11.24%	0.08%	25.32%
AR EUR H	2.92%	10.26%	-1.81%	14.19%
AT	3.41%	11.47%	1.11%	49.65%
AT AUD H	3.18%	10.72%	-1.69%	54.55%
AT CAD H	3.27%	11.03%	-0.31%	38.30%
AT EUR H	2.87%	10.21%	-1.90%	31.86%
AT GBP H	3.19%	10.87%	-1.63%	39.26%
AT SGD H	3.36%	11.19%	0.06%	42.19%
B2	2.93%	10.42%	0.11%	35.67%
BT	2.97%	10.46%	0.03%	35.71%
BT CAD H	2.77%	9.96%	-1.25%	26.46%
C2	3.17%	11.01%	0.62%	43.13%
CT	3.17%	10.98%	0.63%	33.36%
I2	3.72%	12.12%	1.64%	57.87%
I2 CHF H	2.98%	10.64%	-1.72%	22.00%
I2 EUR H	3.11%	10.76%	-1.41%	39.27%
I2 GBP H	3.42%	11.42%	-1.15%	47.00%
IT	3.67%	12.10%	1.67%	46.98%
IT EUR H	3.12%	10.72%	-1.28%	19.00%
IT GBP H	3.41%	11.42%	-0.85%	25.30%
IT SGD H	3.67%	11.83%	0.57%	30.83%
N2	3.12%	10.88%	0.52%	29.80%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Short Duration High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
NT	3.06%	10.87%	0.50%	29.82%
S	4.00%	12.86%	2.31%	69.67%
S1	3.77%	12.30%	1.84%	61.33%
W2 CHF H	3.07%	10.79%	-1.59%	9.53%

Select US Equity Portfolio

Klasse				
A	19.60%	41.22%	8.85%	240.54%
A AUD H	19.36%	39.90%	3.49%	68.53%
A CHF H	18.71%	39.07%	5.11%	98.40%
A CZK H	19.12%	39.47%	5.56%	41.31%
A EUR H	19.04%	39.60%	5.54%	199.67%
A GBP H	19.24%	39.72%	5.07%	210.73%
A PLN H	19.37%	40.03%	5.81%	42.39%
A SGD H	19.54%	40.69%	7.06%	218.53%
AR	19.59%	41.21%	8.86%	103.12%
AR EUR H	19.07%	39.60%	5.55%	82.51%
C	19.34%	40.60%	8.34%	194.60%
F	20.45%	43.27%	10.43%	273.07%
F EUR H	19.90%	41.67%	7.13%	223.67%
I	20.06%	42.38%	9.69%	267.54%
I CHF H	19.18%	40.20%	5.96%	110.87%
I EUR H	19.52%	40.73%	6.38%	223.67%
I GBP H	19.76%	40.91%	5.90%	235.74%
I SGD H	19.99%	41.81%	7.91%	155.27%
N	19.33%	40.59%	8.33%	181.47%
S	20.75%	43.98%	10.99%	311.20%
S EUR H	20.19%	42.38%	7.20%	261.54%
S GBP H	20.43%	42.48%	7.14%	276.54%
S1	20.30%	42.93%	10.15%	282.47%
S1 EUR H	19.78%	41.30%	6.97%	239.60%
S1 GBP H	19.98%	41.44%	6.33%	249.94%
S1 JPY	26.57%	45.54%	9.63%	49.30%
S1 JPY H	20.02%	42.25%	7.61%	47.09%
S1 SGD H	20.28%	42.55%	8.15%	84.08%
W	19.12%	41.71%	10.52%	119.27%
W CHF H	17.67%	38.29%	6.97%	90.93%
W EUR H	18.41%	39.91%	7.12%	95.13%
W GBP H	18.71%	40.13%	6.35%	98.80%
W SGD H	19.15%	41.29%	8.66%	110.33%

Global Plus Fixed Income Portfolio

Klasse				
1	-1.09%	1.89%	4.55%	87.27%
1 EUR H	-1.54%	0.87%	1.91%	61.73%
1 GBP H	-1.24%	1.49%	2.41%	81.20%
1D	-1.12%	1.93%	4.50%	80.33%
1D EUR H	-1.52%	0.91%	1.93%	54.29%
1D GBP H	-1.17%	1.58%	2.33%	76.50%
2	-1.08%	1.95%	4.60%	88.40%
2 EUR H	-1.54%	0.95%	1.94%	62.47%
2 GBP H	-1.23%	1.56%	2.48%	81.87%
A2	-1.31%	1.46%	4.06%	30.07%
A2 EUR H	-1.82%	0.41%	1.42%	15.20%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Global Plus Fixed Income Portfolio (Fortsetzung)</u>				
Klasse				
A2 SGD H	-1.32%	1.30%	3.29%	14.40%
AR EUR H	-1.78%	0.46%	1.35%	4.66%
AT	-1.30%	1.46%	4.06%	30.18%
AT AUD H	-1.48%	1.12%	2.02%	35.16%
AT CAD H	-1.42%	1.20%	3.05%	24.67%
AT EUR H	-1.83%	0.38%	1.36%	15.50%
AT GBP H	-1.44%	1.12%	1.90%	19.28%
AT SGD H	-1.31%	1.32%	3.30%	23.51%
C2	-1.52%	1.02%	3.57%	24.93%
C2 EUR H	-2.06%	-0.06%	0.97%	11.00%
CT	-1.53%	0.99%	3.58%	15.27%
I2	-1.06%	1.99%	4.68%	36.93%
I2 EUR H	-1.56%	0.94%	2.09%	21.80%
I2 GBP H	-1.17%	1.62%	2.47%	29.47%
S	-0.72%	2.72%	5.37%	38.40%
S CAD H	-0.82%	2.42%	4.38%	14.62%
S GBP H	-0.79%	2.39%	3.24%	71.06%
S1	-1.00%	2.21%	4.85%	32.67%
S1 EUR H	-1.41%	1.21%	2.13%	59.84%
SA	-0.70%	2.69%	5.40%	15.57%

Select Absolute Alpha Portfolio

Klasse				
A	9.88%	19.44%	4.63%	67.53%
A AUD H	9.77%	19.04%	2.20%	47.53%
A CHF H	9.14%	17.88%	1.91%	25.73%
A EUR H	9.64%	18.58%	2.05%	53.20%
A GBP H	9.58%	18.59%	2.35%	58.60%
A PLN H	9.90%	19.38%	3.98%	21.56%
A SGD H	9.80%	19.13%	3.95%	67.27%
C	9.65%	18.99%	4.28%	50.80%
F	11.77%	23.52%	6.66%	104.47%
F EUR H	11.44%	22.53%	4.07%	83.80%
I	10.19%	20.23%	5.02%	79.47%
I CHF H	9.60%	18.79%	2.44%	33.20%
I EUR H	10.52%	19.66%	2.45%	63.13%
I GBP H	9.92%	19.34%	3.11%	66.20%
N	9.72%	19.06%	4.32%	43.67%
S	13.42%	27.05%	7.85%	132.67%
S EUR H	13.06%	26.05%	5.15%	107.73%
S GBP H	13.16%	26.17%	5.23%	116.67%
S1	12.85%	25.79%	6.79%	93.80%
S1 EUR H	10.53%	19.65%	3.19%	65.20%
S1 GBP H	10.01%	19.54%	3.20%	72.13%
S1 JPY H	9.90%	19.63%	3.72%	46.34%
S13 EUR H	10.59%	20.84%	—	20.59%
W	10.26%	20.34%	5.58%	29.00%
W CHF H	9.58%	18.84%	2.74%	19.00%

Emerging Market Local Currency Debt Portfolio

Klasse				
A2	0.42%	6.31%	2.33%	-3.33%
A2 CZK H	-0.33%	4.96%	0.04%	-10.37%
A2 EUR H	-0.24%	4.79%	-0.50%	-16.87%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Emerging Market Local Currency Debt Portfolio (Fortsetzung)</u>				
Klasse				
A2 PLN H	-0.24%	5.08%	0.43%	3.45%
AA	0.46%	6.37%	2.31%	12.58%
AT	0.41%	6.33%	–	5.04%
AT SGD H	0.25%	5.98%	1.06%	9.34%
I2	0.66%	6.86%	2.96%	1.73%
I2 EUR H	-0.08%	5.31%	0.00%	-12.67%
S	1.15%	7.86%	3.95%	11.60%
S1	0.77%	7.08%	3.23%	4.87%
SA	1.18%	7.87%	–	0.98%
ZT	1.22%	8.00%	4.14%	20.14%

Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio

Klasse				
A2	0.47%	9.59%	3.93%	29.47%
A2 AUD H	0.19%	8.88%	2.04%	38.20%
A2 EUR H	-0.18%	8.19%	1.09%	13.53%
A2 SGD H	0.32%	9.26%	3.06%	25.07%
AA	0.47%	9.60%	3.87%	15.25%
AA AUD H	0.11%	8.76%	1.95%	11.14%
AA CAD H	0.22%	9.02%	2.82%	11.78%
AA EUR H	-0.19%	8.16%	1.16%	5.40%
AA GBP H	0.15%	8.91%	1.99%	9.10%
AA SGD H	0.30%	9.16%	3.13%	12.16%
AR EUR H	-0.11%	8.17%	1.17%	8.87%
AT	0.41%	9.48%	3.92%	29.44%
AT AUD H	0.18%	8.96%	1.90%	38.27%
AT CAD H	0.27%	9.12%	2.81%	24.27%
AT EUR H	-0.11%	8.26%	1.22%	13.41%
AT GBP H	0.28%	9.14%	1.92%	19.68%
AT SGD H	0.28%	9.19%	3.08%	25.05%
BT AUD H	-0.32%	7.82%	1.03%	25.66%
C2	0.27%	9.08%	3.45%	24.13%
C2 EUR H	-0.43%	7.66%	0.66%	8.67%
I2	0.74%	10.19%	4.45%	36.27%
I2 EUR H	0.06%	8.68%	1.79%	19.33%
I2 SGD H	0.61%	9.83%	3.69%	31.87%
IT	0.73%	10.16%	4.53%	36.19%
IT AUD H	0.39%	9.51%	2.54%	35.87%
IT EUR H	0.04%	8.66%	1.80%	19.07%
IT SGD H	0.64%	9.91%	3.68%	28.98%
S	1.18%	11.15%	5.43%	48.20%
S1	0.82%	10.40%	4.76%	39.40%

Emerging Market Corporate Debt Portfolio

Klasse				
A2	3.64%	16.24%	-0.59%	55.60%
A2 AUD H	3.34%	15.20%	-3.83%	50.53%
A2 CAD H	3.46%	15.50%	-2.28%	41.60%
A2 EUR H	3.05%	14.57%	-3.28%	37.33%
A2 GBP H	3.37%	15.27%	-3.41%	34.87%
A2 SGD H	3.62%	15.88%	-1.72%	41.07%
AA	3.66%	16.26%	-0.61%	41.41%
AA AUD H	3.30%	15.17%	-3.87%	41.46%
AA SGD H	3.59%	15.80%	-1.70%	31.21%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Emerging Market Corporate Debt Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AR EUR	1.41%	5.79%	0.05%	24.76%
AT	3.67%	16.25%	-0.67%	37.16%
AT AUD H	3.36%	15.17%	-3.81%	50.68%
AT CAD H	3.46%	15.47%	-2.23%	41.07%
AT EUR H	3.08%	14.59%	-3.28%	28.32%
AT GBP H	3.39%	15.27%	-3.42%	34.87%
AT NZD H	3.47%	15.42%	-3.03%	55.73%
AT RMB H	4.69%	18.50%	-0.42%	64.32%
AT SGD H	3.66%	15.83%	-1.69%	41.07%
C2	3.39%	15.71%	-1.02%	34.07%
CT	3.45%	15.72%	-1.04%	32.25%
I2	3.94%	16.84%	0.00%	63.73%
I2 EUR H	3.34%	15.18%	-2.70%	44.20%
IT	3.95%	16.88%	-0.03%	43.62%
N2	3.32%	15.52%	-1.09%	33.00%
NT	3.33%	15.49%	-1.11%	32.80%
S	4.44%	18.03%	1.01%	80.27%
S1	4.07%	17.15%	0.32%	68.93%
ZT	0.84%(10)	—	—	0.84%

US High Yield Portfolio

Klasse				
A2	5.03%	17.52%	1.21%	64.13%
A2 EUR H	4.48%	15.95%	-1.89%	44.47%
A2 SEK H	4.60%	9.79%(11)	—	9.79%
C2	4.77%	17.05%	0.75%	25.87%
I2	5.33%	18.22%	1.72%	72.60%
I2 EUR H	4.78%	16.61%	-1.36%	52.13%
I2 SEK H	4.92%	10.19%(11)	—	10.19%
IT	1.37%(12)	—	—	1.37%
N2	4.77%	16.94%	0.64%	22.87%
NT	4.72%	16.87%	0.67%	22.28%
S1	5.49%	18.56%	2.13%	78.00%
S1 EUR H	4.95%	16.99%	—	12.54%
ZT	5.87%	19.35%	2.76%	31.00%

Low Volatility Equity Portfolio

Klasse				
A	12.29%	24.46%	2.45%	135.73%
A AUD H	12.04%	23.45%	-1.53%	101.07%
A EUR	9.85%	13.39%	—	15.20%
A EUR H	11.80%	23.18%	-0.19%	109.73%
A NZD H	12.19%	23.77%	-1.13%	108.60%
A PLN H	11.85%	23.10%	0.15%	21.97%
A SGD H	12.27%	24.17%	1.03%	94.53%
AD	12.28%	24.45%	2.44%	101.23%
AD AUD H	12.04%	23.46%	-1.59%	99.98%
AD CAD H	12.08%	23.84%	-0.25%	78.81%
AD EUR H	11.77%	23.14%	-0.22%	68.21%
AD GBP H	12.03%	23.55%	-0.74%	73.02%
AD NZD H	12.17%	23.79%	-1.03%	108.21%
AD RMB H	13.48%	26.96%	2.57%	28.24%
AD SGD H	12.24%	24.15%	1.04%	94.47%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)</u>				
Klasse				
AD ZAR H	14.77%	29.32%	–	30.25%
AR	12.26%	24.42%	2.43%	57.42%
AR EUR H	11.77%	23.24%	-0.20%	42.18%
C	12.01%	23.91%	1.99%	61.00%
ED	11.72%	23.18%	1.46%	33.34%
ED AUD H	11.49%	22.18%	–	15.24%
ED ZAR H	14.26%	28.06%	–	21.21%
I	12.75%	25.46%	3.29%	152.27%
I EUR	10.30%	14.25%	–	17.07%
I EUR H	12.24%	24.12%	0.59%	123.67%
I GBP	5.86%	9.13%	–	13.20%
I GBP H	12.53%	24.65%	0.00%	52.07%
I SGD H	12.70%	25.15%	1.88%	94.07%
ID	12.69%	16.01%(13)	–	16.01%
N	12.03%	23.90%	1.98%	61.40%
S	13.20%	26.48%	4.17%	171.60%
S EUR H	12.69%	25.15%	1.47%	141.53%
S1	12.91%	25.85%	3.64%	160.60%
S1 EUR	10.45%	14.60%	–	17.89%
S1 EUR H	12.41%	24.56%	0.98%	131.27%
S1D	12.93%	25.86%	–	21.94%
SD	13.21%	26.52%	4.14%	33.73%

Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio

Klasse				
A	11.71%	40.40%	-3.66%	60.33%
AD	11.72%	40.38%	-3.60%	12.54%
AD AUD H	11.07%	38.41%	-7.31%	5.62%
AD CAD H	11.31%	39.15%	-5.86%	7.37%
AD EUR H	11.00%	38.17%	-6.21%	3.53%
AD GBP H	11.35%	39.23%	-6.22%	5.81%
AD NZD H	11.34%	39.02%	-6.23%	7.50%
AD SGD H	11.62%	39.82%	-4.86%	9.20%
F	12.49%	42.32%	-2.23%	25.18%
F EUR H	11.72%	39.99%	-4.78%	14.42%
I	12.20%	41.56%	-2.86%	69.87%
I GBP H	11.78%	40.36%	-5.48%	14.53%
I SGD H	12.02%	40.87%	-4.08%	19.27%
S	12.71%	42.93%	-1.84%	82.67%
S EUR	10.26%	30.10%	–	19.25%
S GBP	5.89%	24.37%	0.51%	96.67%
S1	12.25%	41.75%	-2.62%	72.27%

Global Dynamic Bond Portfolio

Klasse				
A2 CHF H	-1.01%	1.45%	-1.16%	-2.00%
A2 EUR H	-0.85%	1.61%	-0.86%	0.93%
A2 SGD H	-0.36%	2.66%	0.87%	10.60%
A2 USD H	-0.29%	2.83%	1.72%	13.73%
AR EUR H	-0.81%	1.78%	-0.89%	0.68%
I2	-0.30%	2.89%	0.31%	11.40%
I2 CHF H	-0.85%	1.87%	-0.73%	1.47%
I2 EUR H	-0.57%	2.27%	-0.32%	5.20%
I2 USD H	-0.11%	3.33%	2.27%	17.80%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global Dynamic Bond Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S	0.04%	3.53%	1.16%	56.33%
S EUR H	-0.36%	2.84%	0.44%	10.87%
S USD H	0.27%	3.99%	3.32%	25.07%
S1	-0.17%	3.07%	0.73%	14.27%
S1 EUR H	-0.55%	2.40%	0.19%	7.87%
S1 SGD H	-0.07%	3.26%	—	4.89%
S1 USD H	0.00%	3.53%	2.63%	21.13%
S1QD	-0.19%	3.07%	0.76%	5.91%
SQD	0.04%	3.56%	1.13%	11.94%

Concentrated US Equity Portfolio

Klasse				
A	16.17%	37.87%	15.16%	173.07%
A AUD H	15.83%	36.27%	9.68%	170.73%
A EUR	13.64%	25.45%	15.97%	140.53%
A EUR H	15.46%	35.81%	11.39%	147.00%
A SGD H	16.10%	37.30%	13.30%	168.20%
AR EUR	13.64%	25.46%	15.94%	120.38%
C	15.92%	37.19%	14.65%	164.13%
I	16.65%	39.01%	16.10%	190.07%
I AUD H	16.32%	37.40%	10.37%	186.53%
I CHF H	15.75%	36.84%	11.97%	154.33%
I EUR H	15.94%	36.95%	12.19%	161.40%
I GBP	9.58%	20.98%	—	28.80%
I GBP H	16.33%	37.61%	11.63%	167.80%
I SGD H	16.61%	38.47%	14.24%	185.07%
N	15.88%	37.19%	14.65%	164.13%
S	17.16%	40.20%	17.18%	211.80%
S EUR H	16.42%	38.10%	13.26%	180.80%
S1	16.71%	39.14%	16.31%	194.33%
S1 EUR H	16.01%	37.06%	12.43%	165.27%
S1 GBP H	16.85%	38.38%	11.79%	128.33%
SD	17.12%	40.17%	17.20%	81.16%

Concentrated Global Equity Portfolio

Klasse				
A	14.52%	37.54%	11.97%	148.67%
A EUR H	13.75%	35.36%	8.91%	119.47%
A SGD H	14.40%	37.04%	10.46%	104.47%
AR EUR	12.03%	25.23%	12.69%	95.57%
C	14.25%	36.92%	11.48%	79.00%
I	15.03%	38.80%	12.89%	164.27%
I CAD H	14.71%	37.62%	10.43%	85.60%
I CHF H	14.04%	36.39%	9.43%	125.87%
I EUR	12.52%	26.39%	—	30.60%
I EUR H	14.26%	36.60%	9.72%	133.40%
I GBP	8.10%	20.86%	—	29.00%
I GBP H	14.70%	37.44%	9.24%	139.33%
N	14.26%	36.95%	11.54%	97.67%
S	15.52%	40.04%	14.10%	186.33%
S EUR H	14.73%	37.82%	10.95%	152.40%
S GBP	8.54%	21.86%	16.83%	171.27%
S1	15.03%	38.84%	13.15%	168.33%
S1 EUR H	14.22%	36.64%	9.99%	136.67%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Global Core Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	18.05%	38.35%	4.34%	84.00%
A AUD H	17.72%	37.04%	-1.08%	75.87%
A EUR H	17.37%	36.49%	1.88%	62.60%
A SGD H	18.02%	37.96%	2.62%	76.87%
AR EUR	15.46%	25.87%	5.05%	70.58%
C	17.78%	37.65%	3.90%	78.40%
I	18.46%	39.40%	5.23%	94.60%
I AUD H	18.16%	38.07%	-0.40%	85.20%
I CHF H	17.73%	37.42%	2.86%	68.20%
I EUR	15.93%	26.97%	–	22.73%
I EUR H	17.83%	37.63%	2.69%	71.40%
I GBP H	18.10%	38.16%	1.27%	75.73%
I SGD H	18.46%	39.07%	3.54%	87.00%
INN EUR	15.91%	22.09%(14)	–	22.09%
IX EUR	16.03%	27.14%	6.21%	285.03%
N	17.78%	37.73%	3.90%	78.40%
RX EUR	15.31%	25.62%	4.85%	237.52%
S	19.01%	40.58%	6.23%	107.87%
S EUR H	18.38%	38.84%	3.65%	83.73%
S GBP H	18.59%	39.27%	2.20%	102.87%
S NOK HP	17.83%	34.31%	–	22.10%
S1	18.61%	39.74%	5.58%	99.27%
S1 EUR H	18.04%	38.03%	2.70%	74.93%
S1 NOK HP	17.47%	33.56%	–	67.58%
SD	18.99%	40.57%	6.23%	47.87%
<u>Global Income Portfolio</u>				
Klasse				
A2	0.29%	8.17%	1.89%	16.53%
A2 AUD H	0.00%	7.44%	-0.51%	10.67%
A2 CAD H	0.06%	7.62%	0.45%	12.00%
A2 CHF H	-0.45%	6.64%	-1.28%	3.87%
A2 EUR H	-0.31%	6.80%	-0.87%	5.73%
A2 GBP H	0.06%	7.54%	-0.59%	8.33%
A2 PLN H	-0.07%	7.44%	0.32%	9.43%
A2 SGD H	0.18%	7.90%	1.04%	11.93%
AA	0.22%	8.15%	1.92%	15.84%
AA AUD H	0.04%	7.55%	-0.58%	11.98%
AA CAD H	0.12%	7.68%	0.50%	12.34%
AA EUR H	-0.34%	6.79%	-0.81%	6.66%
AA SGD H	0.20%	7.89%	1.06%	13.13%
AT	0.24%	8.15%	1.92%	16.56%
AT AUD H	-0.01%	7.53%	-0.56%	10.79%
AT CAD H	0.09%	7.70%	0.48%	12.12%
AT EUR H	-0.26%	6.91%	-0.89%	5.29%
AT GBP H	0.05%	7.49%	-0.50%	8.36%
AT SGD H	0.21%	7.99%	0.99%	11.95%
I2	0.51%	8.76%	2.49%	19.20%
I2 AUD H	0.29%	8.05%	0.00%	13.60%
I2 CAD H	0.41%	8.28%	1.02%	14.20%
I2 CHF H	-0.19%	7.22%	-0.74%	5.93%
I2 EUR H	-0.06%	7.35%	-0.33%	8.07%
I2 GBP H	0.30%	8.06%	0.00%	11.67%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Global Income Portfolio (Fortsetzung)</u>				
Klasse				
I2 SGD H	0.47%	8.51%	1.54%	14.80%
IT	0.46%	8.69%	2.43%	19.03%
IT AUD H	0.30%	8.06%	-0.02%	13.60%
IT CAD H	0.37%	8.24%	1.05%	14.18%
IT EUR H	-0.02%	7.35%	-0.30%	8.21%
IT SGD H	0.45%	8.51%	1.52%	14.72%
S	0.86%	9.50%	3.21%	22.57%
S EUR H	0.34%	8.14%	0.43%	11.03%
S GBP H	0.68%	8.87%	0.68%	13.96%
S1	0.61%	8.94%	2.70%	20.12%
S1 EUR H	0.06%	7.61%	-0.08%	9.08%
S1 GBP H	0.43%	8.34%	0.24%	12.01%
<u>Alternative Risk Premia Portfolio</u>				
Klasse				
F	2.96%	7.55%	-2.61%	0.95%
F EUR H	2.43%	6.53%	-5.02%	-6.65%
F GBP H	2.80%	7.17%	-4.41%	-3.77%
I	2.75%	7.18%	-2.99%	-0.47%
I EUR H	2.22%	6.15%	-5.38%	-7.93%
I GBP H	2.60%	6.76%	-4.79%	-5.20%
S	3.21%	8.04%	-2.18%	2.38%
S1	2.84%	7.28%	-2.85%	-0.08%
S1 EUR H	2.31%	6.27%	-5.29%	-7.56%
S1 GBP H	2.66%	6.87%	-4.71%	-4.82%
S3 AUD H	3.00%	7.64%	—	2.37%
<u>European Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	19.25%	33.85%	-9.95%	91.40%
A AUD H	19.55%	33.82%	-11.50%	69.60%
A HKD H	19.76%	34.94%	—	7.84%
A SGD H	19.85%	35.04%	-8.70%	63.40%
A USD H	20.00%	35.51%	-7.36%	68.40%
AD	19.37%	33.96%	-9.96%	52.65%
AD AUD H	19.48%	33.83%	-11.54%	69.87%
AD SGD H	19.85%	35.00%	-8.70%	63.10%
AD USD H	19.91%	35.49%	-7.35%	68.25%
B	18.75%	32.57%	-10.83%	57.10%
BD AUD H	18.90%	32.55%	-12.45%	57.40%
BD USD H	19.41%	34.26%	-8.23%	61.56%
C	18.96%	33.21%	-10.33%	151.36%
C USD H	19.73%	34.87%	-7.74%	52.13%
I	19.74%	34.89%	-9.26%	142.00%
I GBP	14.96%	29.00%	—	11.20%
I USD H	20.50%	36.62%	-6.56%	63.40%
S	20.28%	36.14%	-8.38%	103.97%
S1	19.91%	35.29%	-8.90%	23.14%
S1 GBP	15.19%	29.38%	—	11.81%
S1X	19.93%	35.33%	-8.85%	77.72%
SD	20.27%	36.11%	-8.35%	77.06%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Eurozone Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	16.37%	37.42%	-12.04%	106.13%
A AUD H	16.61%	37.27%	-14.25%	75.07%
A PLN H	16.63%	37.16%	-11.58%	15.58%
A SGD H	16.90%	38.68%	-11.08%	75.20%
A USD H	16.92%	39.23%	-9.64%	81.00%
AR	16.35%	37.32%	-12.03%	10.31%
AX	16.45%	37.45%	-12.00%	59.30%
BX	15.87%	36.10%	-12.89%	27.80%
C	16.08%	36.72%	-12.40%	96.33%
C USD H	16.69%	38.66%	-10.10%	65.47%
CX	16.11%	36.75%	-12.34%	14.60%
I	16.82%	38.49%	-11.34%	124.53%
I GBP	12.15%	32.32%	—	13.27%
I USD H	17.39%	40.37%	-8.96%	77.80%
INN	16.88%	38.47%	-11.31%	19.50%
IX	16.83%	38.53%	-11.31%	90.20%
S	17.37%	39.78%	-10.46%	58.97%
S1	16.99%	38.84%	-11.01%	131.87%
S1 GBP	12.33%	32.77%	—	11.72%
S1 USD H	17.61%	41.21%	-8.63%	100.33%
S1N	17.08%	39.07%	-10.92%	23.32%
S1N USD	19.68%	52.77%	-11.29%	35.01%
<u>American Growth Portfolio</u>				
Klasse				
A	12.65%	32.45%	28.76%	768.10%
A EUR H	11.95%	30.48%	25.35%	426.54%
A PLN H	11.99%	30.59%	26.58%	57.53%
A SGD H	12.59%	31.89%	—	35.93%
AD	12.63%	32.44%	28.79%	210.15%
AD AUD H	12.45%	31.22%	24.02%	208.15%
AD RMB H	13.80%	35.08%	28.85%	63.19%
AD ZAR H	14.62%	37.02%	32.39%	332.61%
AX	12.98%	33.22%	29.52%	1780.10%
B	12.10%	31.13%	27.50%	581.28%
BD	12.10%	31.13%	27.52%	190.32%
BD ZAR H	14.18%	35.73%	31.00%	301.10%
BX	13.00%	33.24%	29.52%	1611.11%
C	12.40%	31.85%	28.18%	1155.65%
C EUR H	11.71%	29.88%	24.78%	404.14%
ED	12.11%	31.14%	27.48%	78.53%
I	13.11%	33.52%	29.80%	981.10%
I EUR H	12.42%	31.53%	26.35%	476.47%
I GBP	6.24%	16.21%	—	36.20%
I GBP H	12.97%	32.43%	—	56.80%
N	12.39%	31.85%	28.17%	169.60%
S	13.61%	34.70%	—	53.92%
S1	13.23%	33.82%	30.16%	571.61%
S1 EUR H	12.54%	31.83%	26.66%	64.32%
SD	13.60%	34.70%	31.01%	265.75%
SK	13.20%	33.76%	30.08%	476.36%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
All Market Income Portfolio				
Klasse				
A	6.04%	17.07%	-7.39%	25.27%
A CHF H	5.33%	15.46%	-10.29%	8.07%
A EUR H	5.56%	15.72%	-10.14%	11.40%
A HKD	6.19%	17.21%	-8.45%	25.67%
A SGD H	6.05%	16.85%	-8.45%	21.60%
A2X	6.25%	17.47%	-7.05%	63.20%
AD	6.08%	17.03%	-7.37%	25.54%
AD AUD H	5.80%	16.02%	-10.44%	23.00%
AD CAD H	5.87%	16.44%	-9.17%	18.96%
AD EUR H	5.40%	15.60%	-10.16%	10.68%
AD GBP H	5.87%	16.36%	-9.99%	15.79%
AD HKD	6.18%	17.21%	-8.45%	25.65%
AD NZD H	5.97%	16.38%	-9.69%	26.67%
AD RMB H	7.13%	19.42%	—	12.86%
AD SGD H	6.02%	16.84%	-8.48%	21.65%
AD ZAR H	8.43%	21.44%	-4.86%	63.78%
AMG	6.07%	17.13%	-7.39%	10.09%
AMG EUR H	5.47%	15.63%	-10.11%	3.37%
ANN	6.03%	17.07%	-7.39%	10.08%
ANN EUR H	5.48%	15.64%	-10.06%	3.39%
AQG	6.04%	17.04%	-7.36%	10.06%
AQG EUR H	5.39%	15.61%	-10.09%	3.36%
AR EUR H	5.47%	15.70%	-10.03%	7.27%
AX	6.25%	17.43%	-7.05%	63.45%
B	5.53%	15.90%	-8.34%	17.13%
B2X	5.70%	16.31%	-8.04%	38.33%
BX	5.72%	16.32%	-7.98%	38.50%
C	5.85%	16.56%	-7.84%	20.60%
C2X	6.01%	16.97%	-7.51%	51.67%
CD	5.85%	16.53%	-7.77%	21.43%
CX	6.01%	16.97%	-7.52%	51.67%
ED	5.53%	15.93%	-8.33%	11.26%
ED AUD H	5.26%	14.81%	-11.26%	1.56%
ED ZAR H	7.92%	20.15%	-5.93%	12.80%
I	6.46%	18.02%	-6.68%	31.87%
I CHF H	5.77%	16.38%	-9.62%	13.67%
I EUR H	5.84%	16.51%	-9.38%	17.13%
I SGD H	6.44%	17.75%	-7.71%	27.80%
ID	6.49%	17.99%	-6.63%	32.17%
IMG	6.48%	18.05%	-6.64%	12.47%
IMG EUR H	5.93%	16.63%	-9.33%	5.66%
INN	6.51%	17.99%	-6.60%	12.48%
INN EUR H	5.96%	16.59%	-9.31%	5.69%
INN GBPH	6.20%	17.19%	-9.22%	7.04%
IQG	6.49%	18.00%	-6.63%	12.42%
IQG EUR H	5.88%	16.56%	-9.41%	5.58%
N	5.84%	16.57%	-7.87%	21.93%
ND	5.85%	16.61%	-7.85%	22.10%
S1	6.57%	18.25%	-6.47%	28.73%
S1 CHF H	5.83%	16.57%	-9.35%	5.52%
S1 EUR H	5.99%	16.79%	-9.18%	6.16%
S1 GBP H	6.36%	17.50%	-8.98%	7.74%
S1D JPY H	6.25%	17.55%	-8.64%	10.42%
S1QG GBP H	6.33%	17.49%	-9.04%	7.66%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>China A Shares Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	9.28%	34.83%	7.44%	45.53%
A AUD H	7.48%	30.01%	–	23.60%
A CAD H	7.82%	31.18%	–	25.93%
A EUR	10.81%	38.39%	4.41%	44.20%
A HKD H	7.94%	31.81%	–	37.57%
A NZD H	7.51%	30.37%	–	25.07%
A SGD H	7.84%	31.10%	–	26.47%
A USD	12.65%	51.48%	4.16%	56.73%
A USD H	8.01%	31.82%	–	37.53%
AD HKD	12.78%	51.60%	–	55.65%
AD HKD H	7.95%	31.83%	–	37.58%
AD SGD H	7.81%	31.09%	–	36.39%
AD USD H	8.05%	31.88%	–	37.59%
I	9.72%	35.95%	8.32%	50.01%
I GBP	6.35%	32.56%	7.46%	45.20%
I USD H	8.44%	32.72%	–	38.73%
S	10.26%	37.26%	9.40%	109.30%
S USD	13.67%	54.22%	–	39.57%
S1	9.78%	36.23%	8.56%	47.76%
S1 EUR	11.35%	39.83%	–	32.13%
S1 GBP	-0.49%(7)	–	–	-0.49%
SP1 USD	13.65%	54.23%	–	174.24%
<u>Financial Credit Portfolio</u>				
Klasse				
A2	4.99%	18.92%	5.24%	29.07%
A2 CHF H	4.32%	17.51%	1.67%	19.00%
A2 EUR H	4.49%	17.75%	1.54%	19.40%
AT	5.01%	19.01%	5.20%	29.15%
I2	5.24%	19.68%	5.78%	31.33%
I2 CHF H	4.61%	18.16%	2.20%	21.00%
I2 EUR H	4.72%	18.28%	1.99%	21.20%
I2 GBP H	5.09%	19.03%	1.44%	22.60%
IT	5.27%	19.66%	5.75%	31.30%
S	5.66%	20.44%	6.68%	34.34%
S EUR H	5.09%	19.22%	2.92%	24.21%
S GBP H	5.40%	19.70%	2.09%	25.10%
S1	5.40%	19.90%	6.12%	32.34%
S1 EUR H	4.85%	18.63%	2.41%	22.35%
S1 GBP H	5.14%	19.13%	1.58%	23.22%
ZT	5.74%	20.59%	6.69%	34.64%
<u>Low Volatility Total Return Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	-1.46%	-6.34%	-2.57%	-5.53%
A AUD H	-1.53%	-6.32%	–	-10.13%
A CAD H	-1.46%	-6.25%	–	-9.93%
A EUR H	-1.91%	-7.03%	–	-11.00%
A GBP H	-1.46%	-6.27%	–	-10.27%
A HKD	-1.25%	-6.12%	–	-9.96%
A NZD H	-1.46%	-6.04%	–	-9.73%
A PLN H	-1.51%	-6.37%	–	-6.10%
A SGD H	-1.39%	-6.31%	–	-9.93%
AD	-1.48%	-6.33%	-2.67%	-5.58%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Low Volatility Total Return Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AD AUD H	-1.50%	-6.38%	—	-10.13%
AD CAD H	-1.49%	-6.25%	—	-9.91%
AD GBP H	-1.51%	-6.34%	—	-10.33%
AD HKD	-1.30%	-6.16%	—	-10.01%
AD NZD H	-1.42%	-6.09%	—	-9.75%
AD SGD H	-1.42%	-6.33%	—	-10.00%
I	-1.10%	-5.56%	-1.86%	-3.80%
I EUR H	-1.45%	-4.53%(15)	—	-4.53%
I PLN H	-1.12%	-5.56%	—	-5.25%
S	-0.53%	-4.62%	-0.91%	-1.57%
S1	-0.76%	-5.09%	-1.41%	-2.71%
S1 JPY H	-1.01%	-5.62%	-3.72%	-6.51%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio				
Klasse				
A2	-2.42%	3.82%	—	5.00%
I2	-2.24%	4.21%	5.71%	10.53%
I2 GBP H	-1.73%	5.08%	—	6.27%
I2 USD H	-1.69%	5.49%	—	8.80%
INN AUD H	-1.87%	4.87%	—	4.87%
S	-1.95%	4.78%	6.18%	11.66%
S1	-2.16%	4.35%	5.73%	10.73%
S1 GBP H	-1.77%	5.10%	—	6.33%
S1 USD H	-1.67%	5.51%	—	8.86%
Event Driven Portfolio				
Klasse				
I	0.33%(16)	—	—	0.33%
S	0.95%(17)	—	—	0.95%
S1	6.06%	5.87%	—	3.94%
S1 EUR H	5.51%	4.96%	—	2.61%
SU	6.02%	5.81%	—	3.84%
Arya European Alpha Portfolio				
Klasse				
F (a)	-1.67%	-3.47%	—	0.20%
F CHF H (a)	-1.88%	-3.97%	—	-0.80%
F JPY H	5.91%	5.07%(18)	—	5.07%
I	-0.07%(19)	—	—	-0.07%
S (a)	-0.96%	-2.36%	—	3.50%
S GBP H (a)	-0.70%	-1.89%	—	-1.20%
SU (a)	-1.86%	-3.55%	—	0.50%
Z (a)	-0.77%	-2.09%	—	3.10%
Z USD	1.32%	1.85%(18)	—	1.85%

Die Wertentwicklung der Anteilklassen der einzelnen Portefeuilles basiert auf dem Nettoinventarwert zum 31. Mai 2021, wobei die Auswirkungen der von der Verwaltungsgesellschaft rückerstatteten bzw. erlassenen Aufwendungen einberechnet wurden. Verkaufsgebühren, die beim Kauf oder bei der Rücknahme von Anteilen erhoben werden können, wurden nicht berücksichtigt. Die Wertentwicklung der ausschüttenden Anteilklassen umfasst die während des Geschäftsjahres ausgeschütteten und wieder angelegten Beträge. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Die Wertentwicklungszahlen berücksichtigen nicht die Provisionen und Kosten, 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 2021.

(a) Die Angaben zur Wertentwicklung werden vom AB Arya ICAV – European Alpha Portfolio übernommen. Siehe Anmerkung A.

Rendite berechnet ab Auflegungsdatum am:

- (1) 20. Mai 2021
- (2) 29. Januar 2021
- (3) 7. April 2021
- (4) 12. April 2021
- (5) 18. März 2021
- (6) 4. Mai 2021
- (7) 1. Februar 2021
- (8) 22. Februar 2021
- (9) 5. Januar 2021
- (10) 23. April 2021
- (11) 30. Oktober 2020
- (12) 9. Februar 2021
- (13) 19. Oktober 2020
- (14) 5. Juni 2020
- (15) 16. Juli 2020
- (16) 11. Mai 2021
- (17) 1. April 2021
- (18) 17. Februar 2021
- (19) 21. Januar 2021

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
GESUNDHEITSWESSEN					
BIOTECHNOLOGIE					
Alexion Pharmaceuticals, Inc.			248,180	\$ 43,816,179	2.4%
Amgen, Inc.			405,260	96,427,564	5.2
CSL Ltd.			164,020	36,632,895	2.0
Genmab A/S			143,680	58,689,191	3.2
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.			110,680	55,608,952	3.0
Vertex Pharmaceuticals, Inc.			351,121	73,254,374	3.9
				<u>364,429,155</u>	<u>19.7</u>
GESUNDHEITSWESSEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF					
ABIOMED, Inc.			81,350	23,150,583	1.3
Align Technology, Inc.			60,180	35,515,227	1.9
Carl Zeiss Meditec AG			107,210	19,841,016	1.1
Cochlear Ltd.			86,830	15,084,939	0.8
Coloplast A/S - Class B			319,740	50,738,991	2.7
Edwards Lifesciences Corp.			480,980	46,125,982	2.5
Fisher & Paykel Healthcare Corp., Ltd.			427,020	9,038,910	0.5
IDEXX Laboratories, Inc.			85,870	47,924,906	2.6
Intuitive Surgical, Inc.			68,140	57,386,145	3.1
Medtronic PLC			377,017	47,726,582	2.6
Penumbra, Inc.			24,550	6,115,650	0.3
Straumann Holding AG			10,870	17,015,805	0.9
Sysmex Corp.			231,400	23,995,329	1.3
				<u>399,660,065</u>	<u>21.6</u>
GESUNDHEITSWESSEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
Cigna Corp.			278,330	72,045,721	3.9
Fleury SA			783,500	3,973,349	0.2
Quest Diagnostics, Inc.			136,320	17,949,254	1.0
UnitedHealth Group, Inc.			424,120	174,703,511	9.4
				<u>14.5</u>	
GESUNDHEITSWESSEN – TECHNOLOGIE					
Veeva Systems, Inc. - Class A			136,690	39,823,264	2.2
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN					
ICON PLC			79,620	17,815,771	1.0
Illumina, Inc.			69,010	27,993,216	1.5
Lonza Group AG			25,440	16,445,919	0.9
Mettler-Toledo International, Inc.			9,960	12,957,462	0.7
Sartorius Stedim Biotech			54,620	23,675,913	1.3
				<u>98,888,281</u>	<u>5.4</u>
PHARMAZEUTIKA					
Astellas Pharma, Inc.			1,852,600	29,560,085	1.6
CSPC Pharmaceutical Group Ltd.			13,502,000	20,304,498	1.1
Eli Lilly & Co.			133,630	26,691,256	1.5
GlaxoSmithKline PLC			2,757,270	52,591,686	2.9
Granules India Ltd.			2,199,828	9,573,400	0.5
Johnson & Johnson			90,350	15,291,738	0.8
Nippon Shinyaku Co., Ltd.			292,800	21,064,249	1.1
Novo Nordisk A/S - Class B			1,172,810	92,588,596	5.0
Pfizer, Inc.			1,862,360	72,129,203	3.9
Roche Holding AG			343,937	120,395,718	6.5
Zoetis, Inc.			458,580	81,021,914	4.4
				<u>541,212,343</u>	<u>29.3</u>
				<u>1,712,684,943</u>	<u>92.7</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
MAXIMUS, Inc.			378,290	35,056,134	1.9
VERBRAUCHSGÜTER					
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE					
Rohto Pharmaceutical Co., Ltd.			637,900	15,783,937	0.8
Gesamtanlagen				<u>\$ 1,763,525,014</u>	<u>95.4%</u>
Termineinlagen					
BNP Paribas, Paris(a)	(0.53)%	—		149,462	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	(0.29)%	—		178,996	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	(0.13)%	—		178,401	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	0.01 %	—		104,311	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	2.99 %	—		36,006	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Credit Suisse AG, Zurich(a)	(1.44)%	—	\$ 209,542	0.0%
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(a)	0.00 %	—	54,728	0.0
Nordea Bank Abp, Oslo(a)	(0.78)%	—	183,035	0.0
SEB, Stockholm(a)	(0.28)%	—	43,660	0.0
SEB, Stockholm(a)	0.01 %	—	91,312,126	5.0
Sumitomo, London(a)	0.01 %	—	182,506	0.0
Termineinlagen insgesamt			<u>92,632,773</u>	<u>5.0</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>(7,811,621)</u>	<u>(0.4)</u>
Nettovermögen			<u>\$ 1,848,346,166</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,427	EUR 1,168	06/21/2021	\$ (2,064)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

EUR – Euro

USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIEEN			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	916,403	\$ 12,291,322	0.8%
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Cognex Corp.	108,010	8,574,914	0.6
Corning, Inc.	349,570	15,251,739	1.0
Flex Ltd.	597,820	10,922,172	0.7
IPG Photonics Corp.	62,570	13,093,398	0.9
Keyence Corp.	24,800	12,259,031	0.8
Samsung SDI Co., Ltd.	14,320	8,219,150	0.6
Taiyo Yuden Co., Ltd.	197,800	9,398,312	0.6
		<u>77,718,716</u>	<u>5.2</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Adyen NV	8,310	19,233,190	1.3
BigCommerce Holdings, Inc.	112,030	6,093,312	0.4
Euronet Worldwide, Inc.	99,940	14,955,022	1.0
MongoDB, Inc.	36,080	10,533,195	0.7
PayPal Holdings, Inc.	156,050	40,576,121	2.7
Shift4 Payments, Inc. - Class A	198,990	18,563,777	1.3
Shopify, Inc. - Class A	19,460	24,186,250	1.6
Snowflake, Inc.	31,086	7,399,401	0.5
Twilio, Inc. - Class A	34,730	11,669,280	0.8
Visa, Inc. - Class A	98,570	22,404,961	1.5
WEX, Inc.	31,040	6,081,046	0.4
		<u>181,695,555</u>	<u>12.2</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Advanced Micro Devices, Inc.	133,900	10,722,712	0.7
Ambarella, Inc.	92,480	9,283,142	0.6
Analog Devices, Inc.	125,580	20,670,468	1.4
Applied Materials, Inc.	252,630	34,895,782	2.4
ASML Holding NV	61,760	41,724,460	2.8
Cree, Inc.	98,230	9,823,982	0.7
Infineon Technologies AG	318,660	12,885,651	0.9
Lam Research Corp.	18,530	12,041,721	0.8
Lattice Semiconductor Corp.	254,980	13,531,789	0.9
MACOM Technology Solutions Holdings, Inc.	179,080	10,601,536	0.7
MediaTek, Inc.	353,000	12,195,122	0.8
Monolithic Power Systems, Inc.	19,290	6,618,785	0.4
NVIDIA Corp.	64,910	42,177,220	2.8
ON Semiconductor Corp.	291,060	11,654,042	0.8
Qorvo, Inc.	61,140	11,171,501	0.8
STMicroelectronics NV	320,990	11,977,580	0.8
Synaptics, Inc.	66,350	8,381,996	0.6
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. (Sponsored ADR)	113,670	13,340,311	0.9
Teradyne, Inc.	92,090	12,188,111	0.8
		<u>305,885,911</u>	<u>20.6</u>
SOFTWARE			
8X8, Inc.	274,060	6,454,113	0.4
Adobe, Inc.	49,410	24,931,298	1.7
ANSYS, Inc.	35,180	11,888,729	0.8
Cloudflare, Inc. - Class A	165,900	13,613,754	0.9
Coinbase Global, Inc. (a)	45,260	10,705,800	0.7
Dassault Systemes SE	44,570	10,237,106	0.7
Datadog, Inc. - Class A	118,870	10,823,114	0.7
DocuSign, Inc.	68,850	13,881,537	0.9
HubSpot, Inc.	28,940	14,596,757	1.0
Manhattan Associates, Inc.	91,510	12,443,530	0.9
Microsoft Corp.	234,030	58,432,610	3.9
Palantir Technologies, Inc. (a)	293,200	6,728,940	0.5
RingCentral, Inc. - Class A	44,170	11,593,300	0.8
ServiceNow, Inc.	15,030	7,122,416	0.5
Trade Desk, Inc. (The) - Class A	14,440	8,492,742	0.6
Unity Software, Inc.	68,220	6,444,061	0.4
Zendesk, Inc.	80,010	10,934,167	0.7
Zoom Video Communications, Inc. - Class A	34,490	11,434,470	0.8
		<u>250,758,444</u>	<u>16.9</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	308,584	38,452,652	2.6
Samsung Electronics Co., Ltd.	254,640	18,278,121	1.2
Western Digital Corp.	239,050	17,983,732	1.2
		<u>74,714,505</u>	<u>5.0</u>
		<u>903,064,453</u>	<u>60.7</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
AT&T, Inc.	238,890	\$ 7,030,533	0.5%
Cellnex Telecom SA	162,365	9,849,997	0.6
		<u>16,880,530</u>	<u>1.1</u>
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	124,790	12,135,827	0.8
Bilibili, Inc. (Sponsored ADR)	82,020	8,790,904	0.6
Kuaishou Technology (a)	207,500	5,364,357	0.4
Live Nation Entertainment, Inc.	121,680	10,964,585	0.7
ROBLOX Corp.	116,380	10,912,953	0.7
Roku, Inc.	28,870	10,009,518	0.7
Sea Ltd. (ADR)	57,560	14,576,494	1.0
Walt Disney Co. (The)	76,620	13,688,163	0.9
		<u>86,442,801</u>	<u>5.8</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	9,390	22,644,548	1.5
Bumble, Inc. (a)	68,558	3,271,588	0.2
Facebook, Inc. - Class A	101,650	33,415,404	2.2
Kakao Corp.	162,500	17,765,626	1.2
Match Group, Inc.	86,678	12,427,892	0.8
Snap, Inc. - Class A	208,790	12,970,035	0.9
Tencent Holdings Ltd.	187,000	14,619,830	1.0
Twitter, Inc.	202,900	11,768,200	0.8
Zillow Group, Inc. - Class C	59,360	6,964,115	0.5
ZoomInfo Technologies, Inc.	196,260	8,602,076	0.6
		<u>144,449,314</u>	<u>9.7</u>
MEDIEN			
News Corp. - Class A	413,270	11,154,157	0.8
		<u>258,926,802</u>	<u>17.4</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	74,480	11,203,282	0.7
KRAFTFAHRZEUGE			
Tesla, Inc.	15,620	9,765,936	0.7
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Airbnb, Inc.(a)	103,264	14,498,266	1.0
Booking Holdings, Inc.	4,720	11,146,516	0.8
DraftKings, Inc.	151,840	7,584,408	0.5
Evolution AB	59,040	11,017,470	0.7
Expedia Group, Inc.	59,780	10,578,071	0.7
Penn National Gaming, Inc.	74,200	6,082,174	0.4
		<u>60,906,905</u>	<u>4.1</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Sony Group Corp.	136,100	13,533,323	0.9
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	256,600	6,862,899	0.5
Amazon.com, Inc.	5,960	19,209,497	1.3
Chewy, Inc.	122,790	9,039,800	0.6
Coupang, Inc.(a)	142,887	5,828,361	0.4
DoorDash, Inc.	26,050	3,914,794	0.3
Farfetch Ltd. - Class A	240,130	11,125,223	0.7
MercadoLibre, Inc.	8,020	10,896,533	0.7
RealReal, Inc. (The)	421,240	7,359,063	0.5
		<u>74,236,170</u>	<u>5.0</u>
FREIZEITPRODUKTE			
Peloton Interactive, Inc.	33,730	3,720,756	0.2
		<u>173,366,372</u>	<u>11.6</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Twist Bioscience Corp.	68,440	7,344,296	0.5
GESUNDHEITSWESEN – AUSTRÜSTUNG UND BEDARF			
Intuitive Surgical, Inc.	12,470	10,501,985	0.7
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Veeva Systems, Inc. - Class A	27,300	7,953,582	0.5
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	16,630	10,017,413	0.7
Illumina, Inc.	25,020	10,149,113	0.7
		<u>20,166,526</u>	<u>1.4</u>
		<u>45,966,389</u>	<u>3.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INDUSTRIEGÜTER					
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG					
Rockwell Automation, Inc.			29,480	\$ 7,774,466	0.5%
MASCHINEN					
FANUC Corp.			47,400	11,363,698	0.8
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN					
Recruit Holdings Co., Ltd.			233,500	11,968,285	0.8
STRASSE UND SCHIENE					
Uber Technologies, Inc.			283,330	14,401,664	1.0
				45,508,113	3.1
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
SBA Communications Corp.			49,340	14,709,241	1.0
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
LG Chem Ltd.			16,220	12,087,741	0.8
				1,453,629,111	97.7
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
Stripe, Inc. (b)			41,537	1,666,672	0.1
Gesamtanlagen				\$ 1,455,295,783	97.8%
Termineinlagen					
(Kosten \$1,042,606,663)					
BNP Paribas, Paris(c)	(0.53)%	—		45,109	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	(0.29)%	—		177,642	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(c)	(1.44)%	—		50,232	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(c)	0.00 %	—		151,601	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(c)	(0.78)%	—		139,546	0.0
JPMorgan Chase, New York(c)	0.01 %	—		28,169,133	1.9
Nordea Bank Abp, Oslo(c)	(0.13)%	—		15,475	0.0
Royal Bank of Canada, Toronto(c)	0.01 %	—		154,688	0.0
SEB, Stockholm(c)	(0.28)%	—		141,530	0.0
Sumitomo, London(c)	0.01 %	—		616,465	0.1
Termineinlagen insgesamt				29,661,421	2.0
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				2,955,752	0.2
Nettovermögen				\$ 1,487,912,956	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 8,361	PLN 30,956	06/21/2021	\$ 59,923
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 66	AUD 85	06/30/2021	(412)
				\$ 59,511
			Wertsteigerung	\$ 59,923
			Wertminderung	\$ (412)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(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

PLN – Polish Zloty

USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
IMMOBILIEN			
IMMOBILIENAKTIVITÄTEN – DIVERSIFIZIERT			
Mitsubishi Estate Co., Ltd.	21,500	\$ 352,713	0.7%
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	56,700	1,342,947	2.9
New World Development Co., Ltd.	95,500	519,096	1.1
Sumitomo Realty & Development Co., Ltd.	7,100	241,277	0.5
Sun Hung Kai Properties Ltd.	56,000	874,540	1.9
UOL Group Ltd.	42,200	236,649	0.5
		<u>3,567,222</u>	<u>7.6</u>
REITS – DIVERSIFIZIERT			
Alexander & Baldwin, Inc.	12,900	247,809	0.5
Armada Hoffer Properties, Inc.	876	11,624	0.0
Broadstone Net Lease, Inc.	9,270	202,457	0.4
Cofinimmo SA	1,390	217,275	0.5
Daiwa House REIT Investment Corp.	165	450,897	1.0
Essential Properties Realty Trust, Inc.	20,839	533,478	1.1
Fibra Uno Administracion SA de CV	75,766	88,821	0.2
ICADE	2,820	253,553	0.6
Land Securities Group PLC	34,850	346,901	0.7
LondonMetric Property PLC	70,440	234,497	0.5
Merlin Properties Socimi SA	38,110	439,574	0.9
Nomura Real Estate Master Fund, Inc.	108	169,918	0.4
Stockland	204,050	734,964	1.6
		<u>3,931,768</u>	<u>8.4</u>
REITS – GESUNDHEITSWESSEN			
Medical Properties Trust, Inc.	37,640	796,839	1.7
Omega Healthcare Investors, Inc.	18,831	689,591	1.5
Physicians Realty Trust	30,730	557,135	1.2
Welltower, Inc.	16,440	1,229,219	2.6
		<u>3,272,784</u>	<u>7.0</u>
REITS – HOTELS UND RESORTS			
Apple Hospitality REIT, Inc.	16,710	265,188	0.5
Park Hotels & Resorts, Inc.	22,650	470,893	1.0
RLJ Lodging Trust	26,430	406,229	0.9
		<u>1,142,310</u>	<u>2.4</u>
REITS – INDUSTRIE			
Americold Realty Trust	18,080	687,402	1.5
Ascendas Real Estate Investment Trust	117,900	259,183	0.5
Dream Industrial Real Estate Investment Trust(a)	19,308	219,763	0.5
GLP J-Reit	181	307,668	0.7
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	144	257,560	0.5
Mitsui Fudosan Logistics Park, Inc.	45	230,945	0.5
Plymouth Industrial REIT, Inc.	4,949	94,724	0.2
Prologis, Inc.	21,860	2,575,982	5.5
Rexford Industrial Realty, Inc.	10,220	564,451	1.2
Segro PLC	49,070	725,578	1.5
STAG Industrial, Inc.	13,730	490,298	1.0
		<u>6,413,554</u>	<u>13.6</u>
REITS – BÜROS			
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	5,655	1,008,060	2.2
Allied Properties Real Estate Investment Trust	8,030	294,798	0.6
alstria office REIT-AG	12,620	231,069	0.5
Boston Properties, Inc.	5,620	660,687	1.4
Cousins Properties, Inc.	13,952	517,480	1.1
Daiwa Office Investment Corp.	33	232,073	0.5
Japan Prime Realty Investment Corp.	60	234,536	0.5
Kilroy Realty Corp.	6,270	440,217	0.9
Nippon Building Fund, Inc.	86	549,863	1.2
True North Commercial Real Estate Investment Trust	15,020	93,249	0.2
		<u>4,262,032</u>	<u>9.1</u>
IMMOBILIENENTWICKLUNG			
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	198,000	172,543	0.4
CK Asset Holdings Ltd.	43,000	292,759	0.6
Instone Real Estate Group AG	10,206	322,966	0.7
		<u>788,268</u>	<u>1.7</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
IMMOBILIEN-BETRIEBSGESELLSCHAFTEN			
ADLER Group SA	16,050	\$ 499,090	1.1%
Aroundtown SA	50,530	426,199	0.9
CA Immobilien Anlagen AG	7,229	313,634	0.7
CTP NV	12,906	240,008	0.5
Deutsche Wohnen SE	3,670	233,663	0.5
Fastighets AB Balder - Class B	7,760	488,489	1.0
Hulic Co., Ltd.	19,800	223,248	0.5
Kojamo Oyj	12,840	293,877	0.6
LEG Immobilien SE	3,950	581,163	1.2
Shurgard Self Storage SA	3,770	179,755	0.4
Swire Properties Ltd.	78,800	237,552	0.5
TAG Immobilien AG	9,090	285,864	0.6
Wharf Real Estate Investment Co., Ltd.	27,000	163,420	0.4
		<u>4,165,962</u>	<u>8.9</u>
REITS – WOHNRAUM			
American Campus Communities, Inc.	11,670	550,357	1.2
American Homes 4 Rent - Class A	17,020	647,951	1.4
Bluerock Residential Growth REIT, Inc.	11,280	109,529	0.2
Comforia Residential REIT, Inc.	70	215,284	0.5
Daiwa Securities Living Investments Corp.	210	213,134	0.4
Equity Residential	1,430	110,753	0.2
Essex Property Trust, Inc.	3,205	946,404	2.0
Independence Realty Trust, Inc.	30,251	516,687	1.1
Invitation Homes, Inc.	19,500	707,265	1.5
Killam Apartment Real Estate Investment Trust	32,640	512,005	1.1
Mid-America Apartment Communities, Inc.	4,530	727,971	1.5
Minto Apartment Real Estate Investment Trust (a)	12,110	215,726	0.5
Sun Communities, Inc.	5,487	918,634	2.0
UDR, Inc.	13,920	663,010	1.4
		<u>7,054,710</u>	<u>15.0</u>
REITS – EINZELHANDEL			
AEON REIT Investment Corp.	139	192,925	0.4
Brixmor Property Group, Inc.	27,570	626,115	1.3
CapitaLand Integrated Commercial Trust	275,452	426,471	0.9
Eurocommercial Properties NV (a)	11,200	333,461	0.7
Link REIT	69,000	665,625	1.4
Mercialys SA	14,970	192,200	0.4
NETSTREIT Corp.	11,420	254,895	0.6
Simon Property Group, Inc.	10,170	1,306,743	2.8
SITE Centers Corp.	37,990	568,710	1.2
Vicinity Centres	438,590	533,828	1.1
		<u>5,100,973</u>	<u>10.8</u>
REITS – SPEZIALISIERT			
CubeSmart	15,170	664,294	1.4
Digital Realty Trust, Inc.	8,984	1,361,615	2.9
EPR Properties	5,870	288,511	0.6
MGM Growth Properties LLC - Class A	13,162	472,121	1.0
National Storage Affiliates Trust	14,010	645,861	1.4
Safestore Holdings PLC	29,740	398,209	0.8
		<u>3,830,611</u>	<u>8.1</u>
		<u>43,530,194</u>	<u>92.6</u>
GRUNDSTOFFE			
BAUMATERIAL			
Breedon Group PLC	121,490	186,206	0.4
Buzzi Unicem SpA	11,490	325,765	0.7
Fletcher Building Ltd.	44,830	241,222	0.5
Grupo Cementos de Chihuahua SAB de CV	15,870	115,969	0.3
		<u>869,162</u>	<u>1.9</u>
PAPIERPRODUKTE			
Stora Enso Oyj - Class R	10,270	182,956	0.4
		<u>1,052,118</u>	<u>2.3</u>
GEBRAUCHSGÜTER UND BEKLEIDUNG			
HAUSBAU			
Persimmon PLC	6,710	300,019	0.6
PulteGroup, Inc.	5,540	320,157	0.7
		<u>620,176</u>	<u>1.3</u>
VERBRAUCHERDIENSTE			
HOTELS, RESORTS UND KREUZFAHRTLINIEN			
Hilton Grand Vacations, Inc.	5,024	229,748	0.5

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
FREIZEITEINRICHTUNGEN					
Planet Fitness, Inc.			1,500	\$ 118,155	0.2%
RESTAURANTS					
Dine Brands Global, Inc.			1,410	133,879	0.3
				<u>481,782</u>	<u>1.0</u>
TRANSPORT					
SCHNELLSTRASSEN UND BAHNGLEISE					
Transurban Group			39,977	428,867	0.9
TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
INTEGRIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Infrastrutture Wireless Italiane SpA			20,350	227,908	0.5
SOFTWARE UND DIENSTLEISTUNGEN					
INTERNETDIENSTE UND INFRASTRUKTUR					
GDS Holdings Ltd. (ADR)			2,470	185,793	0.4
INVESTITIONSGÜTER					
ELEKTRISCHE KOMPONENTEN UND GERÄTE					
Vertiv Holdings Co.			5,930	147,183	0.3
Gesamtanlagen					
(Kosten \$39,814,908)				\$ 46,674,021	99.3%
Termineinlagen					
ANZ, London.(b)	(0.13)%	—		5,086	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(b)	0.01 %	—		4,703	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.29)%	—		3,967	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.00 %	—		8,683	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.01 %	—		2,914	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.44)%	—		4,307	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	—		4,432	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(b)	(0.78)%	—		10,501	0.1
Nordea Bank Abp, Oslo(b)	(0.13)%	—		175	0.0
SEB, Stockholm(b)	(0.28)%	—		4,320	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	—		1,029	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	0.01 %	—		640,898	1.4
Termineinlagen insgesamt				691,015	1.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(364,319)	(0.8)
Nettovermögen				<u>\$ 47,000,717</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC	CNY	1,431	USD	219	06/24/2021	\$ (5,128)
BNP Paribas SA	USD	516	SGD	688	08/19/2021	4,067
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	143	USD	109	06/04/2021	(1,367)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	98	USD	136	06/17/2021	(2,888)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	482	GBP	350	06/17/2021	14,254
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	2,886	USD	143	06/18/2021	(1,807)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	102	NOK	873	07/15/2021	1,934
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	662	SEK	5,616	07/15/2021	14,615
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	170	USD	135	07/16/2021	(5,324)
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD	181	USD	131	07/29/2021	(254)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	515	CHF	465	08/05/2021	2,738
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	66,176	USD	607	08/19/2021	4,409
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	116	JPY	12,564	08/19/2021	(1,158)
Brown Brothers Harriman & Co+... ..	USD	1,440	AUD	1,856	06/30/2021	(8,872)
Brown Brothers Harriman & Co+... ..	USD	385	NZD	528	06/30/2021	(2,886)
Brown Brothers Harriman & Co+... ..	USD	52	SGD	69	06/30/2021	85
HSBC Bank USA	EUR	908	USD	1,114	08/03/2021	5,245
						<u>\$ 17,663</u>
					Wertsteigerung	\$ 47,347
					Wertminderung	\$ (29,684)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
CNY – Chinese Yuan Renminbi
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
JPY – Japanese Yen
MXN – Mexican Peso
NOK – Norwegian Krone
NZD – New Zealand Dollar
SEK – Swedish Krona
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
REIT – Real Estate Investment Trust

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS- AUSRÜSTUNG			
Calix, Inc.	1,243,264	\$ 55,089,042	1.8%
Lumentum Holdings, Inc.	823,031	66,970,026	2.2
Motorola Solutions, Inc.	296,619	60,898,820	2.0
Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	2,208,882	29,626,784	0.9
		<u>212,584,672</u>	<u>6.9</u>
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Flex Ltd.	3,934,277	71,879,243	2.4
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Adyen NV	19,982	46,246,658	1.5
Network International Holdings PLC	4,096,412	23,118,594	0.7
Square, Inc. - Class A	175,930	39,147,958	1.3
Twilio, Inc. - Class A	83,766	28,145,362	0.9
Visa, Inc. - Class A	196,988	44,775,398	1.5
		<u>181,433,970</u>	<u>5.9</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Cree, Inc.	391,972	39,201,139	1.3
Infineon Technologies AG	1,382,246	55,893,870	1.8
NXP Semiconductors NV	275,961	58,343,766	1.9
		<u>153,438,775</u>	<u>5.0</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	90,769	45,800,379	1.5
Coinbase Global, Inc.	119,227	28,202,051	0.9
Dassault Systemes SE	240,044	55,134,648	1.8
Microsoft Corp.	217,042	54,191,093	1.8
Zendesk, Inc.	322,859	44,121,965	1.4
		<u>227,450,136</u>	<u>7.4</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	397,332	49,511,535	1.6
		<u>896,298,331</u>	<u>29.2</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Hexcel Corp.	989,226	58,819,368	1.9
BAUPRODUKTE			
Trex Co., Inc.	647,560	63,078,842	2.1
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Tetra Tech, Inc.	283,376	33,854,951	1.1
TOMRA Systems ASA	1,087,077	56,418,737	1.8
Waste Management, Inc.	523,978	73,713,228	2.4
		<u>163,986,916</u>	<u>5.3</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Rockwell Automation, Inc.	223,392	58,912,996	1.9
Schneider Electric SE (Paris)	285,489	45,438,325	1.5
Vestas Wind Systems A/S	1,473,980	57,621,943	1.9
		<u>161,973,264</u>	<u>5.3</u>
MASCHINEN			
SMC Corp.	78,065	46,968,140	1.5
Xylem, Inc./NY	493,253	58,263,090	1.9
		<u>105,231,230</u>	<u>3.4</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Recruit Holdings Co., Ltd.	1,144,632	58,669,288	1.9
		<u>611,758,908</u>	<u>19.9</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Abcam PLC	1,764,492	35,457,754	1.2
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Alcon, Inc.	615,472	42,823,519	1.4
Danaher Corp.	256,601	65,725,738	2.1
Koninklijke Philips NV	1,294,778	73,163,195	2.4
STERIS PLC	271,818	51,879,220	1.7
		<u>233,591,672</u>	<u>7.6</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	1,363,081	59,187,197	1.9
Laboratory Corp. of America Holdings	323,714	88,852,885	2.9
		<u>148,040,082</u>	<u>4.8</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN					
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A			101,678	\$ 61,247,710	2.0%
Bruker Corp.			677,915	47,074,391	1.5
Gerresheimer AG(a)			294,828	32,592,377	1.1
				<u>140,914,478</u>	<u>4.6</u>
				<u>558,003,986</u>	<u>18.2</u>
FINANZWERTE					
BANKEN					
Erste Group Bank AG(a)			1,775,834	73,559,015	2.4
HDFC Bank Ltd.			2,759,725	57,249,026	1.9
SVB Financial Group			144,563	84,264,260	2.7
				<u>215,072,301</u>	<u>7.0</u>
KAPITALMÄRKTE					
MSCI, Inc. - Class A			133,896	62,680,848	2.0
Partners Group Holding AG(a)			42,634	64,350,245	2.1
				<u>127,031,093</u>	<u>4.1</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER					
Lufax Holding Ltd. (ADR)(a)			1,932,288	23,554,595	0.8
VERSICHERUNGEN					
AIA Group Ltd.			3,331,440	44,462,448	1.5
				<u>410,120,437</u>	<u>13.4</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
Aptiv PLC			417,319	62,773,188	2.0
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER					
TopBuild Corp.			274,383	54,341,647	1.8
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB					
Coupang, Inc.(a)			524,831	21,407,863	0.7
MercadoLibre, Inc.			15,603	21,199,696	0.7
				<u>42,607,559</u>	<u>1.4</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER					
NIKE, Inc. - Class B			421,612	57,533,112	1.9
				<u>217,255,506</u>	<u>7.1</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Chr Hansen Holding A/S			563,500	50,584,631	1.6
Koninklijke DSM NV			293,883	54,153,677	1.8
				<u>104,738,308</u>	<u>3.4</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
NextEra Energy, Inc.			631,761	46,257,545	1.5
Orsted AS			156,699	23,963,807	0.8
				<u>70,221,352</u>	<u>2.3</u>
WASSERVERSORGER					
American Water Works Co., Inc.			222,479	34,488,746	1.1
				<u>104,710,098</u>	<u>3.4</u>
VERBRAUCHSGÜTER					
HAUSHALTSPRODUKTE					
Procter & Gamble Co. (The)			241,944	32,626,115	1.1
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Tencent Holdings Ltd.			373,186	29,175,988	1.0
Gesamtanlagen				<u>\$ 2,964,687,677</u>	<u>96.7%</u>
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	0.01 %	—		724,094	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.01 %	—		1	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.53)%	—		7,901,699	0.3
BNP Paribas, Paris(b)	(0.13)%	—		335,791	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	2.99 %	—		2	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.44)%	—		289,611	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	—		289,374	0.0
Nordea Bank Abp, Oslo(b)	(0.13)%	—		288,022	0.0
SEB, Stockholm(b)	(0.28)%	—		292,923	0.0
Sumitomo, London(b)	(0.29)%	—		285,965	0.0
Sumitomo, London(b)	0.00 %	—		294,059	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Sumitomo, London(b)	0.01 %	—	\$ 51,683,596	1.7%
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.78)%	—	2,368,396	0.1
Termineinlagen insgesamt			<u>64,753,533</u>	<u>2.1</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>37,927,801</u>	<u>1.2</u>
Nettovermögen			<u>\$ 3,067,369,011</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	USD 3,731	AUD 4,891	06/04/2021	\$ 38,798
Bank of America, NA.	USD 5,419	GBP 3,937	06/17/2021	167,289
Bank of America, NA.	USD 8,566	ZAR 125,609	06/17/2021	530,918
Bank of America, NA.	NOK 333,726	USD 39,384	07/15/2021	(524,658)
Bank of America, NA.	USD 6,936	RUB 515,352	07/28/2021	41,797
Barclays Bank PLC	USD 39,510	AUD 51,899	06/04/2021	498,977
Barclays Bank PLC	USD 45,937	CNH 299,591	06/24/2021	1,101,920
Barclays Bank PLC	INR 784,359	USD 10,390	07/15/2021	(361,978)
Barclays Bank PLC	USD 6,460	KRW 7,202,063	07/22/2021	5,277
BNP Paribas SA	NOK 50,575	USD 6,024	07/15/2021	(24,375)
BNP Paribas SA	HKD 126,665	USD 16,314	08/19/2021	(9,861)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 66,336	GBP 48,141	06/17/2021	1,984,001
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 35,837	AUD 46,193	06/30/2021	(222,242)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 16	CAD 19	06/30/2021	45
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 95,670	EUR 78,245	06/30/2021	(201,635)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 22,279	SGD 29,514	06/30/2021	36,212
Citibank, NA	USD 73,320	CAD 91,781	07/16/2021	2,649,651
Deutsche Bank AG.	INR 3,960,753	USD 53,222	07/15/2021	(1,070,026)
Goldman Sachs Bank USA	USD 5,032	GBP 3,557	06/17/2021	15,277
Goldman Sachs Bank USA	USD 12,540	BRL 66,799	07/02/2021	239,686
Goldman Sachs Bank USA	INR 354,384	USD 4,667	07/15/2021	(190,808)
Goldman Sachs Bank USA	USD 5,828	CAD 7,189	07/16/2021	122,983
Goldman Sachs Bank USA	USD 41,680	TWD 1,169,048	07/22/2021	809,973
Goldman Sachs Bank USA	CHF 25,090	USD 27,574	08/05/2021	(365,840)
Goldman Sachs Bank USA	USD 72,734	JPY 7,915,636	08/19/2021	(622,233)
Goldman Sachs Bank USA	BRL 66,799	USD 12,575	06/02/2021	(242,011)
Goldman Sachs Bank USA	USD 12,432	BRL 66,799	06/02/2021	385,472
HSBC Bank USA.	EUR 189,272	USD 232,184	08/03/2021	1,093,242
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 4,755	AUD 6,114	06/04/2021	(41,451)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 41,743	CNH 272,047	06/24/2021	971,152
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 15,694	USD 19,212	08/03/2021	50,311
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 19,963	EUR 16,362	08/03/2021	14,086
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY 2,269,098	USD 20,909	08/19/2021	237,256
Royal Bank of Scotland PLC	INR 390,650	USD 5,269	07/15/2021	(85,918)
Standard Chartered Bank	USD 40,074	KRW 44,681,762	07/22/2021	35,973
Standard Chartered Bank	USD 5,714	TWD 158,983	07/22/2021	64,724
State Street Bank & Trust Co.	CNH 49,131	USD 7,632	06/24/2021	(81,895)
				<u>\$ 7,050,089</u>
			Wertsteigerung	\$ 11,095,020
			Wertminderung	\$ (4,044,931)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
BRL – Brazilian Real
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
HKD – Hong Kong Dollar
INR – Indian Rupee
JPY – Japanese Yen
KRW – South Korean Won
NOK – Norwegisch Krone

RUB – Russian Ruble
SGD – Singapore Dollar
TWD – New Taiwan Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
MSCI – Morgan Stanley Capital International

		Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE				
STAMMAKTIE				
FINANZWERT				
BANKEN				
	Axis Bank Ltd.	269,295	\$ 2,750,290	1.8%
	Bandhan Bank Ltd.	267,281	1,119,782	0.7
	HDFC Bank Ltd.	726,225	15,071,857	9.6
	ICICI Bank Ltd.	988,987	8,778,936	5.6
	IndusInd Bank Ltd.	181,360	2,551,945	1.6
	Kotak Mahindra Bank Ltd.	64,938	1,614,206	1.0
			<u>31,887,016</u>	<u>20.3</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER				
	Bajaj Finance Ltd.	73,699	5,708,067	3.7
	Manappuram Finance Ltd.	1,100,450	2,380,378	1.5
	Muthoot Finance Ltd.	200,094	3,496,829	2.2
	Repco Home Finance Ltd.	890,735	4,120,306	2.6
			<u>15,705,580</u>	<u>10.0</u>
VERSICHERUNGEN				
	Max Financial Services Ltd.	398,922	5,150,179	3.3
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG				
	Housing Development Finance Corp., Ltd.	378,065	13,262,870	8.4
			<u>66,005,645</u>	<u>42.0</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE				
KOMMUNIKATIONS- AUSRÜSTUNG				
	Sterlite Technologies Ltd.	782,995	2,702,126	1.7
IT-DIENSTLEISTUNGEN				
	HCL Technologies Ltd.	268,254	3,490,255	2.2
	Infosys Ltd.	302,611	5,869,256	3.7
	Mindtree Ltd.	26,816	871,971	0.6
	Tata Consultancy Services Ltd.	67,043	2,909,292	1.9
	Tech Mahindra Ltd.	300,091	4,251,212	2.7
			<u>17,391,986</u>	<u>11.1</u>
			<u>20,094,112</u>	<u>12.8</u>
INDUSTRIEGÜTER				
BAUPRODUKTE				
	Kajaria Ceramics Ltd.	97,571	1,286,400	0.8
BAU- UND INGENIEURWESEN				
	Larsen & Toubro Ltd.	42,016	857,285	0.5
	Voltas Ltd.	213,134	2,943,584	1.9
			<u>3,800,869</u>	<u>2.4</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG				
	KEI Industries Ltd.	480,858	4,136,006	2.6
MASCHINEN				
	Escorts Ltd.	47,608	763,877	0.5
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN				
	L&T Technology Services Ltd.	33,756	1,259,120	0.8
STRASSE UND SCHIENE				
	VRL Logistics Ltd.	265,896	906,599	0.6
TRANSPORTWESEN – INFRASTRUKTUR				
	Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	304,346	3,260,767	2.1
			<u>15,413,638</u>	<u>9.8</u>
GRUNDSTOFFE				
CHEMIKALIEN				
	Aarti Industries Ltd.	52,744	1,209,233	0.8
	Alkyl Amines Chemicals	24,488	1,282,669	0.8
	Asian Paints Ltd.	22,561	915,832	0.6
	Atul Ltd.	10,200	1,200,873	0.7
	SRF Ltd.	34,698	3,120,748	2.0
			<u>7,729,355</u>	<u>4.9</u>
METALL UND BERGBAU				
	JSW Steel Ltd.	455,261	4,335,011	2.8
	Tata Steel Ltd.	206,944	3,152,331	2.0
			<u>7,487,342</u>	<u>4.8</u>
			<u>15,216,697</u>	<u>9.7</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
Dr Lal PathLabs Ltd.			19,737	\$ 764,442	0.5%
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN					
Divi's Laboratories Ltd.			51,359	2,921,102	1.8
PHARMAZEUTIKA					
Aurobindo Pharma Ltd.			239,717	3,382,527	2.2
Dr Reddy's Laboratories Ltd.			22,975	1,647,441	1.0
Laurus Labs Ltd.			347,845	2,503,591	1.6
				7,533,559	4.8
				11,219,103	7.1
VERBRAUCHSGÜTER					
HAUSHALTSPRODUKTE					
Hindustan Unilever Ltd.			100,803	3,230,622	2.0
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE					
Godrej Consumer Products Ltd.			116,418	1,357,467	0.9
Marico Ltd.			220,001	1,430,534	0.9
				2,788,001	1.8
TABAK					
ITC Ltd.			1,649,926	4,848,938	3.1
				10,867,561	6.9
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
Balkrishna Industries Ltd.			96,213	2,908,005	1.8
Suprajit Engineering Ltd.			157,198	572,872	0.4
				3,480,877	2.2
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT					
MakeMyTrip Ltd.			65,670	1,805,925	1.2
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER					
Amber Enterprises India Ltd.			20,967	797,610	0.5
Crompton Greaves Consumer Electricals Ltd.			350,722	1,907,748	1.2
				2,705,358	1.7
				7,992,160	5.1
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Reliance Industries Ltd.			275,651	7,968,642	5.1
VERSORGUNG					
GASVERSORGUNGSBETRIEBE					
Gujarat Gas Ltd.			326,725	2,302,421	1.5
Indraprastha Gas Ltd.			373,805	2,650,446	1.7
Mahanagar Gas Ltd.			57,509	932,861	0.6
				5,885,728	3.8
Gesamtanlagen					
(Kosten \$116,159,288).....				\$ 160,663,286	102.3%
Termineinlagen					
DBS Bank Ltd, Singapore.(a)	0.01 %	—		1,419,856	0.9
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(5,082,853)	(3.2)
Nettovermögen				\$ 157,000,289	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 394	AUD 508	06/07/2021	\$ (1,703)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 61	PLN 229	06/07/2021	983
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 165	SGD 221	06/07/2021	1,508
				\$ 788
			Wertsteigerung	\$ 2,491
			Wertminderung	\$ (1,703)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Ashland Services BV	2.00%	01/30/2028	EUR 1,440	€ 1,429,400	0.4%
Chemours Co. (The)	4.00%	05/15/2026	1,490	1,524,995	0.4
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	988	1,008,599	0.3
INEOS Quattro Finance 2 PLC	2.50%	01/15/2026	996	1,000,004	0.3
INEOS Styrolution Group GmbH	2.25%	01/16/2027	1,367	1,338,062	0.4
K&S AG	3.25%	07/18/2024	2,000	2,043,751	0.6
Kleopatra Holdings 2 SCA	6.50%	09/01/2026	300	288,522	0.1
Kraton Polymers LLC/Kraton Polymers Capital Corp	5.25%	05/15/2026	266	273,085	0.1
Kronos International, Inc.	3.75%	09/15/2025	691	704,805	0.2
Nouryon Holding BV	6.50%	10/01/2026	587	613,525	0.2
OCI NV	3.63%	10/15/2025	842	879,907	0.2
Schoeller Packaging BV	6.38%	11/01/2024	1,300	1,353,308	0.4
SGL Carbon SE	4.63%	09/30/2024	816	828,014	0.2
Solvay Finance SAC(A)	5.87%	06/03/2024	813	913,554	0.2
Solvay SA(a)	2.50%	12/02/2025	200	205,151	0.1
SpA Holdings 3 Oy	3.63%	02/04/2028	1,454	1,466,625	0.4
SPCM SA	2.63%	02/01/2029	700	716,447	0.2
thyssenkrupp AG	2.50%	02/25/2025	2,464	2,515,886	0.7
thyssenkrupp AG	2.88%	02/22/2024	544	554,468	0.1
WEPA Hygieneprodukte GmbH	2.88%	12/15/2027	1,478	1,463,380	0.4
				<u>21,121,488</u>	<u>5.9</u>
INVESTITIONSGÜTER					
ARD Finance SA(b)	5.00%	06/30/2027	3,000	3,063,505	0.9
Ardagh Metal Packaging	2.00%	09/01/2028	2,000	1,994,160	0.6
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC	3.00%	09/01/2029	1,050	1,045,690	0.3
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.75%	07/15/2027	GBP 1,541	1,824,741	0.5
Ellaktor Value PLC	6.38%	12/15/2024	EUR 1,422	1,370,492	0.4
Mauser Packaging Solutions Holding Co	4.75%	04/15/2024	2,210	2,208,885	0.6
Paprec Holding SA	4.00%	03/31/2025	1,419	1,440,288	0.4
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	2,067	2,145,273	0.6
Rolls-Royce PLC	1.63%	05/09/2028	1,100	1,017,987	0.3
Rolls-Royce PLC	4.63%	02/16/2026	2,020	2,182,732	0.6
Sofima Holding SpA	3.75%	01/15/2028	1,423	1,427,188	0.4
Titan Global Finance PLC	2.75%	07/09/2027	506	524,575	0.1
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	1,865	1,951,962	0.5
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	2,065	2,102,705	0.6
Verallia SA	1.63%	05/14/2028	700	701,748	0.2
Vertical Holdco GmbH	6.63%	07/15/2028	1,164	1,244,825	0.4
Webuild SpA	5.88%	12/15/2025	455	495,108	0.1
				<u>26,741,864</u>	<u>7.5</u>
KOMMUNIKATIONS MEDIEN					
Altice Financing SA	3.00%	01/15/2028	1,806	1,734,176	0.5
Altice Finco SA	4.75%	01/15/2028	1,745	1,710,100	0.5
Banijay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025	739	744,735	0.2
Banijay Group SAS	6.50%	03/01/2026	986	1,015,844	0.3
Netflix, Inc.	3.63%	05/15/2027	4,190	4,808,463	1.4
Netflix, Inc.	3.63%	06/15/2030	596	704,876	0.2
Summer BC Holdco A SARL	9.25%	10/31/2027	378	403,113	0.1
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	1,097	1,143,951	0.3
UPC Holding BV	3.88%	06/15/2029	1,800	1,821,355	0.5
UPCB Finance VII Ltd.	3.63%	06/15/2029	866	885,485	0.2
Virgin Media Finance PLC	3.75%	07/15/2030	1,000	997,120	0.3
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027	GBP 1,420	1,723,000	0.5
Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	4.88%	07/15/2028	684	811,934	0.2
VZ Vendor Financing II BV	2.88%	01/15/2029	EUR 800	780,393	0.2
Ziggo Bond Co. BV	3.38%	02/28/2030	3,150	3,102,750	0.9
				<u>22,387,295</u>	<u>6.3</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	3.38%	01/15/2028	208	204,583	0.1
Altice France SA/France	4.13%	01/15/2029	300	304,215	0.1
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	4,850	5,162,071	1.4
Matterhorn Telecom SA	4.00%	11/15/2027	2,670	2,744,363	0.8
SES SA(a)	5.63%	01/29/2024	554	604,425	0.2
Telecom Italia Finance SA	7.75%	01/24/2033	977	1,429,585	0.4
Telecom Italia SpA/Milano	1.63%	01/18/2029	824	805,788	0.2
Telecom Italia SpA/Milano	2.38%	10/12/2027	1,970	2,041,252	0.6
Telecom Italia SpA/Milano	2.75%	04/15/2025	1,015	1,066,152	0.3
Telecom Italia SpA/Milano	2.88%	01/28/2026	170	180,013	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Telefonica Europe BV(a)	2.38%	02/12/2029	EUR 300	€ 289,497	0.1%
Telefonica Europe BV(a)	2.88%	06/24/2027	2,200	2,225,887	0.6
Telefonica Europe BV(a)	4.38%	12/14/2024	4,000	4,323,589	1.2
Telefonica Europe BV(a)	5.88%	03/31/2024	500	555,028	0.1
United Group BV	3.13%	02/15/2026	1,809	1,761,851	0.5
United Group BV	4.00%	11/15/2027	2,480	2,465,589	0.7
Vmed O2 UK Financing I PLC	3.25%	01/31/2031	970	977,278	0.3
Vodafone Group PLC, Series NC10	3.00%	08/27/2080	900	915,930	0.2
Vodafone Group PLC, Series NC6	2.63%	08/27/2080	1,800	1,845,939	0.5
				<u>29,903,035</u>	<u>8.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient Global Holdings Ltd.	3.50%	08/15/2024	885	909,721	0.3
Adler Pelzer Holding GmbH	4.13%	04/01/2024	790	761,811	0.2
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	806	835,350	0.2
Dana Financing Luxembourg SARL	3.00%	07/15/2029	427	434,168	0.1
Faurecia SE	2.38%	06/15/2027	1,380	1,410,263	0.4
Faurecia SE	2.38%	06/15/2029	301	305,938	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	1.74%	07/19/2024	2,050	2,062,304	0.6
Ford Motor Credit Co. LLC	2.39%	02/17/2026	1,400	1,436,714	0.4
Ford Motor Credit Co. LLC	3.02%	03/06/2024	2,115	2,201,950	0.6
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.63%	05/15/2025	1,841	1,875,872	0.5
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.75%	09/15/2026	1,217	1,246,185	0.4
Jaguar Land Rover Automotive PLC	4.50%	01/15/2026	1,861	1,939,193	0.5
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	816	887,263	0.3
Jaguar Land Rover Automotive PLC	6.88%	11/15/2026	860	982,742	0.3
Renault SA	1.13%	10/04/2027	600	548,298	0.2
Renault SA	1.25%	06/24/2025	2,800	2,737,973	0.8
Renault SA	2.38%	05/25/2026	500	499,042	0.1
Renault SA	2.50%	04/01/2028	800	790,218	0.2
Schaeffler AG	2.75%	10/12/2025	400	424,308	0.1
Schaeffler AG	2.88%	03/26/2027	1,420	1,508,973	0.4
Schaeffler AG	3.38%	10/12/2028	1,200	1,307,916	0.4
Superior Industries International, Inc.	6.00%	06/15/2025	520	526,285	0.1
TI Automotive Finance PLC	3.75%	04/15/2029	1,791	1,804,432	0.5
ZF Europe Finance BV	2.00%	02/23/2026	3,200	3,211,708	0.9
ZF Finance GmbH	2.00%	05/06/2027	600	601,223	0.2
ZF Finance GmbH	2.75%	05/25/2027	1,000	1,032,822	0.3
ZF Finance GmbH	3.00%	09/21/2025	1,000	1,053,927	0.3
ZF Finance GmbH	3.75%	09/21/2028	400	434,500	0.1
				<u>33,771,099</u>	<u>9.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	1,710	1,892,121	0.5
Carnival Corp.	10.13%	02/01/2026	1,550	1,807,772	0.5
CPUK Finance Ltd.	4.50%	08/28/2027	GBP 1,052	1,233,691	0.4
Dometic Group AB	3.00%	05/08/2026	EUR 490	518,453	0.1
Explorer II AS	3.38%	02/24/2025	1,204	1,133,503	0.3
Motion Bondco DAC	4.50%	11/15/2027	1,410	1,381,441	0.4
Pinnacle Bidco PLC	5.50%	02/15/2025	1,220	1,236,279	0.4
TUI Cruises GmbH	6.50%	05/15/2026	420	436,754	0.1
				<u>9,640,014</u>	<u>2.7</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Accor SA(a)	2.63%	01/30/2025	1,400	1,352,816	0.4
Accor SA(a)	4.38%	01/30/2024	1,700	1,769,409	0.5
Cirsa Finance International SARL	4.75%	05/22/2025	1,760	1,743,962	0.5
Cirsa Finance International SARL	6.25%	12/20/2023	970	985,062	0.3
Ferrovial Netherlands BV(a)	2.12%	02/14/2023	1,170	1,162,770	0.3
Gamma Bidco SpA	5.13%	07/15/2025	880	900,017	0.2
International Game Technology PLC	2.38%	04/15/2028	1,307	1,279,768	0.4
International Game Technology PLC	3.50%	07/15/2024	700	736,187	0.2
International Game Technology PLC	3.50%	06/15/2026	2,098	2,164,225	0.6
Samsonite Finco SARL	3.50%	05/15/2026	572	557,143	0.1
Scientific Games International, Inc.	3.38%	02/15/2026	320	320,038	0.1
Scientific Games International, Inc.	5.50%	02/15/2026	570	576,125	0.2
				<u>13,547,522</u>	<u>3.8</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
BK LC Lux Finco1 SARL	5.25%	04/30/2029	1,600	1,630,921	0.5
CT Investment GmbH	5.50%	04/15/2026	1,218	1,242,501	0.3
Douglas GmbH	6.00%	04/08/2026	530	534,209	0.2
Dufry One BV	2.00%	02/15/2027	667	621,977	0.2
Dufry One BV	3.38%	04/15/2028	1,246	1,228,804	0.3
eG Global Finance PLC	4.38%	02/07/2025	740	723,209	0.2
				<u>5,981,621</u>	<u>1.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Avantor Funding, Inc.	3.88%	07/15/2028	EUR 498	€ 524,372	0.1%
Boparan Finance PLC	7.63%	11/30/2025	GBP 450	494,008	0.1
Cab Selas	3.38%	02/01/2028	EUR 1,619	1,614,950	0.5
Casino Guichard Perrachon SA	4.05%	08/05/2026	400	388,633	0.1
Casino Guichard Perrachon SA	4.50%	03/07/2024	1,000	1,020,450	0.3
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	977	983,296	0.3
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	4.38%	01/15/2028	1,563	1,617,487	0.5
Chrome Bidco SASU	3.50%	05/31/2028	622	626,608	0.2
Chrome Holdco SASU	5.00%	05/31/2029	394	401,127	0.1
Cidron Aida Finco SARL	5.00%	04/01/2028	2,056	2,081,404	0.6
Gruenthal GmbH	3.63%	11/15/2026	375	382,931	0.1
Gruenthal GmbH	4.13%	05/15/2028	285	291,233	0.1
International Design Group SpA	6.50%	11/15/2025	223	233,372	0.1
IQVIA, Inc.	2.25%	03/15/2029	1,650	1,645,875	0.5
IQVIA, Inc.	2.88%	06/15/2028	868	895,221	0.2
Laboratoire Eimer Selas	5.00%	02/01/2029	169	171,737	0.0
Nidda Healthcare Holding GmbH	3.50%	09/30/2024	3,174	3,174,000	0.9
Organon Finance I LLC	2.88%	04/30/2028	2,100	2,131,683	0.6
Sigma Holdco BV	5.75%	05/15/2026	1,329	1,275,800	0.4
Tereos Finance Groupe I SA	4.13%	06/16/2023	1,400	1,415,741	0.4
Tereos Finance Groupe I SA	7.50%	10/30/2025	440	470,514	0.1
				<u>21,840,442</u>	<u>6.2</u>
ENERGIE					
Repsol International Finance BV(a)	3.75%	03/11/2026	2,621	2,785,148	0.8
Repsol International Finance BV	4.50%	03/25/2025	1,253	1,365,610	0.4
Rubis Terminal Infra SAS	5.63%	05/15/2025	659	693,891	0.2
Saipem Finance International BV	2.63%	01/07/2025	1,620	1,663,217	0.4
				<u>6,507,866</u>	<u>1.8</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	1,300	1,336,375	0.4
Parts Europe SA	6.50%	07/16/2025	557	587,744	0.1
Rexel SA	2.13%	06/15/2028	515	523,349	0.2
SPIE SA	2.63%	06/18/2026	1,500	1,555,349	0.4
Stena International SA	3.75%	02/01/2025	977	972,115	0.3
				<u>4,974,932</u>	<u>1.4</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./Atlas Luxco 4 SARL	3.63%	06/01/2028	1,323	1,320,654	0.4
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 449	522,314	0.1
Arena Luxembourg Finance SARL	1.88%	02/01/2028	EUR 1,268	1,184,609	0.3
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023	1,250	1,243,159	0.3
Elis SA	1.63%	04/03/2028	1,400	1,375,270	0.4
La Financiere Atalian SASU	4.00%	05/15/2024	560	549,707	0.2
La Financiere Atalian SASU	5.13%	05/15/2025	665	665,354	0.2
Q-Park Holding I BV	2.00%	03/01/2027	2,840	2,704,687	0.8
Rakuten Group, Inc.(a)	4.25%	04/22/2027	1,200	1,227,279	0.3
Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH	2.00%	07/15/2025	1,816	1,793,849	0.5
Verisure Holding AB	3.25%	02/15/2027	980	987,868	0.3
Verisure Holding AB	3.88%	07/15/2026	2,357	2,415,096	0.7
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	880	906,445	0.3
				<u>16,896,291</u>	<u>4.8</u>
TECHNOLOGIE					
Banff Merger Sub, Inc.	8.38%	09/01/2026	655	687,803	0.2
Boxer Parent Co., Inc.	6.50%	10/02/2025	1,051	1,119,400	0.3
Brunello Bidco SpA	3.50%	02/15/2028	1,540	1,541,184	0.4
Playtech PLC	4.25%	03/07/2026	1,638	1,688,134	0.5
				<u>5,036,521</u>	<u>1.4</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Deutsche Lufthansa AG	3.00%	05/29/2026	900	902,419	0.3
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Atlantia SpA	1.63%	02/03/2025	610	622,852	0.2
Atlantia SpA	1.88%	07/13/2027	938	963,475	0.3
Autostrade per l'Italia SpA	1.75%	06/26/2026	1,775	1,810,460	0.5
Autostrade per l'Italia SpA	1.88%	11/04/2025	1,250	1,285,534	0.4
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	12/04/2028	182	187,612	0.1
Autostrade per l'Italia SpA	2.00%	01/15/2030	808	822,242	0.2
Autostrade per l'Italia SpA	4.38%	09/16/2025	638	726,811	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Avis Budget Finance PLC	4.13%	11/15/2024	EUR 444	€ 451,297	0.1%
Avis Budget Finance PLC	4.50%	05/15/2025	374	380,505	0.1
Avis Budget Finance PLC	4.75%	01/30/2026	822	836,939	0.2
CMA CGM SA	5.25%	01/15/2025	1,870	1,914,918	0.5
CMA CGM SA	7.50%	01/15/2026	625	692,209	0.2
Gatwick Airport Finance PLC	4.38%	04/07/2026	GBP 450	529,699	0.2
Kapla Holding SAS	3.38%	12/15/2026	EUR 1,091	1,085,530	0.3
Loxam SAS	2.88%	04/15/2026	653	650,976	0.2
Loxam SAS	3.25%	01/14/2025	1,855	1,875,384	0.5
Loxam SAS	3.75%	07/15/2026	1,092	1,111,509	0.3
				<u>15,947,952</u>	<u>4.5</u>
				<u>235,200,361</u>	<u>66.2</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Abanca Corp. Bancaria SA(a)	6.00%	01/20/2026	800	841,351	0.2
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	1.88%	01/09/2026	600	601,888	0.2
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	5.38%	01/18/2028	2,320	2,089,894	0.6
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	8.00%	01/22/2030	1,000	1,008,199	0.3
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(a)	5.88%	09/24/2023	1,200	1,292,797	0.4
Banco BPM SpA(a)	8.75%	06/18/2024	600	684,020	0.2
Banco Comercial Portugues SA	3.87%	03/27/2030	900	894,377	0.3
Banco De Credito Social Cooper	5.25%	11/27/2031	300	306,414	0.1
Banco de Sabadell SA	2.50%	04/15/2031	1,100	1,100,715	0.3
Banco de Sabadell SA	5.63%	05/06/2026	900	1,047,813	0.3
BPER Banca	1.88%	07/07/2025	1,505	1,563,054	0.4
CaixaBank SA(a)	5.88%	10/09/2027	2,400	2,743,288	0.8
Credit Suisse Group AG(a)	6.38%	08/21/2026	USD 1,364	1,222,616	0.3
Credit Suisse Group AG(a)	7.50%	07/17/2023	462	408,649	0.1
Deutsche Bank AG	4.50%	05/19/2026	EUR 2,700	3,091,016	0.9
Intesa Sanpaolo SpA	5.88%	03/04/2029	770	864,336	0.2
Intesa Sanpaolo SpA	3.93%	09/15/2026	974	1,089,493	0.3
Raiffeisen Bank International AG(a)	6.00%	06/15/2026	2,400	2,607,901	0.7
				<u>23,457,821</u>	<u>6.6</u>
FINANZEN					
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	2,219	2,246,965	0.6
VERSICHERUNGEN					
Intesa Sanpaolo Vita SpA(a)	4.75%	12/17/2024	1,100	1,204,703	0.4
Societa Cattolica Di Assicurazione SpA	4.25%	12/14/2047	1,100	1,197,017	0.3
Unipol Gruppo SpA	3.25%	09/23/2030	297	313,421	0.1
Unipol Gruppo SpA	3.50%	11/29/2027	1,900	2,063,984	0.6
UnipolSai Assicurazioni SpA	3.88%	03/01/2028	700	753,096	0.2
UnipolSai Assicurazioni SpA(a)	6.38%	04/27/2030	650	720,706	0.2
				<u>6,252,927</u>	<u>1.8</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Intrum AB	3.00%	09/15/2027	1,530	1,505,799	0.4
Intrum AB	3.13%	07/15/2024	1,620	1,629,778	0.5
Intrum AB	3.50%	07/15/2026	1,698	1,719,569	0.5
Motion Finco SARL	7.00%	05/15/2025	1,030	1,085,467	0.3
				<u>5,940,613</u>	<u>1.7</u>
REITS					
ADLER Group SA	1.88%	01/14/2026	500	492,406	0.1
ADLER Group SA	2.25%	01/14/2029	700	678,326	0.2
ADLER Group SA	2.75%	11/13/2026	500	507,530	0.1
ADLER Group SA	3.25%	08/05/2025	1,500	1,558,578	0.4
ADLER Real Estate AG	3.00%	04/27/2026	2,500	2,600,364	0.7
Aedas Homes Opco SLU	4.00%	08/15/2026	891	907,130	0.3
DEMIRE Deutsche Mittelstand Real Estate AG	1.88%	10/15/2024	900	876,840	0.3
Fastighets AB Balder	2.87%	06/02/2081	700	694,596	0.2
Fastighets AB Balder	3.00%	03/07/2078	1,017	1,035,270	0.3
Flamingo Lux II SCA	5.00%	03/31/2029	880	873,620	0.3
Foncia Management SASU	3.38%	03/31/2028	1,240	1,230,700	0.4
Heimstaden Bostad AB(a)	2.63%	02/01/2027	700	693,134	0.2
Heimstaden Bostad AB(a)	3.38%	01/15/2026	1,000	1,036,100	0.3
Neinor Homes SA	4.50%	10/15/2026	475	483,249	0.1
Peach Property Finance GmbH	3.50%	02/15/2023	1,745	1,782,383	0.5
Peach Property Finance GmbH	4.38%	11/15/2025	465	486,071	0.1
Samhallsbyggnadsbolaget i Norden AB(a)	4.63%	04/27/2024	1,150	1,223,352	0.3
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA	5.25%	04/01/2026	363	375,773	0.1
				<u>17,535,422</u>	<u>4.9</u>
				<u>55,433,748</u>	<u>15.6</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte/ Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
ContourGlobal Power Holdings SA.....	2.75%	01/01/2026	EUR 810	€ 816,326	0.2%
ContourGlobal Power Holdings SA.....	3.13%	01/01/2028	1,423	1,432,370	0.4
ContourGlobal Power Holdings SA.....	4.13%	08/01/2025	790	807,375	0.2
Orano SA.....	2.75%	03/08/2028	400	416,662	0.1
Public Power Corp. SA.....	3.88%	03/30/2026	550	567,954	0.2
				<u>4,040,687</u>	<u>1.1</u>
				<u>294,674,796</u>	<u>82.9</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Commerzbank AG.....	4.00%	12/05/2030	1,900	2,088,656	0.6
Cooperatieve Rabobank UA(a).....	4.38%	06/29/2027	2,000	2,199,445	0.6
Credit Agricole SA(a).....	7.88%	01/23/2024	USD 935	865,798	0.3
Credit Agricole SA(a).....	8.13%	12/23/2025	920	912,871	0.3
Erste Group Bank AG(a).....	5.13%	10/15/2025	EUR 2,400	2,637,647	0.7
HSBC Holdings PLC(a).....	6.38%	09/17/2024	USD 2,900	2,604,043	0.7
ING Groep NV(a).....	5.75%	11/16/2026	1,200	1,083,414	0.3
KBC Group NV(a).....	4.75%	10/24/2025	EUR 1,000	1,068,526	0.3
Svenska Handelsbanken AB(a).....	4.75%	03/01/2031	USD 600	516,653	0.2
UBS Group AG(a).....	5.13%	07/29/2026	571	504,728	0.1
UBS Group AG(a).....	7.00%	01/31/2024	1,240	1,121,788	0.3
UniCredit SpA.....	2.00%	09/23/2029	EUR 1,460	1,463,020	0.4
UniCredit SpA.....	4.88%	02/20/2029	3,310	3,602,329	1.0
				<u>20,668,918</u>	<u>5.8</u>
VERSICHERUNGEN					
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	2,277	2,342,714	0.7
REITS					
Akelius Residential Property AB.....	2.25%	05/17/2081	862	860,577	0.2
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.....	3.69%	06/05/2028	GBP 840	1,031,436	0.3
				<u>1,892,013</u>	<u>0.5</u>
				<u>24,903,645</u>	<u>7.0</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
INEOS Finance PLC.....	2.88%	05/01/2026	EUR 1,045	1,061,381	0.3
INEOS Finance PLC.....	3.38%	03/31/2026	2,436	2,520,390	0.7
				<u>3,581,771</u>	<u>1.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cellnex Finance Co. SA.....	1.25%	01/15/2029	600	582,268	0.2
Cellnex Finance Co. SA.....	2.00%	02/15/2033	300	291,552	0.1
Cellnex Telecom SA.....	1.75%	10/23/2030	1,800	1,759,782	0.5
Cellnex Telecom SA.....	1.88%	06/26/2029	900	909,627	0.2
				<u>3,543,229</u>	<u>1.0</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc., Series B(a).....	2.88%	03/02/2025	600	606,000	0.2
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Kraft Heinz Foods Co.....	2.25%	05/25/2028	2,054	2,224,355	0.6
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Travis Perkins PLC.....	3.75%	02/17/2026	GBP 1,126	1,385,153	0.4
TECHNOLOGIE					
Nokia Oyj.....	3.13%	05/15/2028	EUR 1,070	1,177,351	0.3
				<u>12,517,859</u>	<u>3.5</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Naturgy Finance BV(a).....	3.38%	04/24/2024	1,100	1,161,032	0.3
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Veolia Environnement SA(a).....	2.25%	01/20/2026	700	708,807	0.2
				<u>1,869,839</u>	<u>0.5</u>
				<u>39,291,343</u>	<u>11.0</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT.....			115,258	10,984,727	3.1
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Sazka Group AS.....	3.88%	02/15/2027	EUR 1,788	1,743,859	0.5

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte/ Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	1.13%	10/15/2024	EUR 1,055	€ 993,662	0.3%
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	4.50%	03/01/2025	670	700,157	0.2
				<u>1,693,819</u>	<u>0.5</u>
				<u>3,437,678</u>	<u>1.0</u>
GEKAUFTE OPTIONEN – KAUFPTIONEN					
OPTIONEN AUF FONDS UND INVESTMENTVERMÖGEN					
S&P 500 Index Expiration: Jun 2021, Exercise Price: \$100.00(c)...			104,150	294,751	0.1
				<u>348,683,295</u>	<u>98.1</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco Espirito Santo SA(d)	4.75%	01/15/2018	EUR 600	84,000	0.1
Banco Espirito Santo SA(d)	4.00%	01/21/2019	300	42,000	0.0
				<u>126,000</u>	<u>0.1</u>
VERSICHERUNGEN					
Guardian Life Insurance Co. of America (The)	4.85%	01/24/2077	USD 13	12,866	0.0
				<u>138,866</u>	<u>0.1</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Kleopatra Finco SARL	4.25%	03/01/2026	EUR 967	967,492	0.3
INVESTITIONSGÜTER					
Sarens Finance Co. NV	5.75%	02/21/2027	571	567,990	0.1
				<u>1,535,482</u>	<u>0.4</u>
				<u>1,674,348</u>	<u>0.5</u>
STAMMAKTIE					
STAMMAKTIE					
BIS Industries Holdings Ltd.(e)			175,243	0	0.0
K201640219 South Africa Ltd. A Shares(e)			3,574,808	3	0.0
K201640219 South Africa Ltd. B Shares(e)			564,959	1	0.0
				<u>4</u>	<u>0.0</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
NIEDERLANDE					
SNS Bank NV Series E(a) (e)	11.25%	12/31/2049	EUR 200	0	0.0
SNS Reaal NV(a) (e)	6.26%	12/31/2049	260	0	0.0
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K2016470260 South Africa Ltd.(b) (e)	25.00%	12/31/2022	USD 152	0	0.0
				<u>1,674,352</u>	<u>0.5</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten €344,478,783)				<u>€350,357,647</u>	<u>98.6%</u>
Termineinlagen					
BNP Paribas, Paris(f)	(0.13)%	—		19	0.0
Sumitomo, London(f)	0.01 %	—		129,958	0.1
Sumitomo, Tokyo(f)	(0.78)%	—		<u>1,034,170</u>	<u>0.3</u>
Termineinlagen insgesamt				<u>1,164,147</u>	<u>0.4</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>3,708,719</u>	<u>1.0</u>
Nettovermögen				<u>€355,230,513</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Euro-BOBL Futures	06/08/2021	14	€ 1,890,140	€ 1,886,360	€ (3,780)
Short					
Euro-Bund Futures	06/08/2021	14	2,394,860	2,379,160	15,700
Long Gilt Futures	09/28/2021	13	1,922,582	1,925,154	(2,572)
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2021	40	4,743,942	4,754,705	(10,763)

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	15	€ 1,520,857	€ 1,523,452	€ (2,595)
					€ (4,010)
				Wertsteigerung	€ 15,700
				Wertminderung	€ (19,710)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	EUR 483	GBP 416	06/17/2021	€ 1,208
Bank of America, NA	GBP 1,568	EUR 1,814	06/17/2021	(10,120)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 354	GBP 304	06/17/2021	161
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 304	EUR 354	06/17/2021	(708)
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 6	CNH 46	06/07/2021	37
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 3,563	USD 4,326	06/07/2021	(16,583)
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 6	CNH 48	06/21/2021	89
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 6	HKD 53	06/21/2021	10
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 77	PLN 348	06/21/2021	623
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 11	SGD 17	06/21/2021	102
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 3,564	USD 4,354	06/21/2021	5,470
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 184	AUD 289	06/30/2021	(801)
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 20	CHF 22	06/30/2021	(16)
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 10	GBP 9	06/30/2021	54
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 5	HKD 51	06/30/2021	12
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 11	SGD 18	06/30/2021	37
Brown Brothers Harriman & Co. +	EUR 10,139	USD 12,397	06/30/2021	21,445
Deutsche Bank AG	USD 23,918	EUR 19,523	08/03/2021	(66,582)
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP 6,063	EUR 7,004	06/17/2021	(50,223)
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP 904	EUR 1,054	06/17/2021	3,130
Royal Bank of Scotland PLC	GBP 459	EUR 530	06/17/2021	(4,418)
				€ (117,073)
				Wertsteigerung € 32,378
				Wertminderung € (149,451)

+ 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) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (c) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.
- (d) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.
- (f) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

BOBL – Bundesobligationen
 CBT – Chicago Board of Trade
 REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Dana, Inc.	46,261	\$ 1,255,061	0.7%
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	116,550	2,311,187	1.4
Lear Corp.	9,518	1,840,400	1.1
		<u>5,406,648</u>	<u>3.2</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Hillenbrand, Inc.	32,590	1,486,104	0.9
Houghton Mifflin Harcourt Co.	71,859	714,278	0.4
		<u>2,200,382</u>	<u>1.3</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Dine Brands Global, Inc.	18,240	1,731,888	1.0
Hilton Grand Vacations, Inc.	39,510	1,806,792	1.1
Papa John's International, Inc.	16,249	1,526,594	0.9
Scientific Games Corp./DE - Class A	27,370	1,985,420	1.2
		<u>7,050,694</u>	<u>4.2</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
KB Home	38,549	1,804,478	1.1
PulteGroup, Inc.	49,072	2,835,871	1.7
Taylor Morrison Home Corp. - Class A	40,466	1,198,603	0.7
		<u>5,838,952</u>	<u>3.5</u>
FREIZEITPRODUKTE			
Brunswick Corp./DE	14,412	1,473,339	0.9
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Foot Locker, Inc.	35,485	2,245,846	1.3
Gap, Inc. (The)	48,320	1,616,304	1.0
Sally Beauty Holdings, Inc.	84,000	1,832,040	1.1
Williams-Sonoma, Inc.	9,682	1,641,486	1.0
		<u>7,335,676</u>	<u>4.4</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Carter's, Inc.	20,980	2,144,995	1.3
Kontoor Brands, Inc.	32,360	2,071,687	1.2
Ralph Lauren Corp.	17,074	2,118,542	1.3
Steven Madden Ltd.	31,310	1,296,234	0.8
Tapestry, Inc.	56,090	2,517,880	1.5
		<u>10,149,338</u>	<u>6.1</u>
		<u>39,455,029</u>	<u>23.6</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
AAR Corp. (a)	9,677	404,015	0.2
Spirit AeroSystems Holdings, Inc. - Class A	42,380	2,085,520	1.3
		<u>2,489,535</u>	<u>1.5</u>
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
XPO Logistics, Inc.	15,446	2,269,481	1.4
FLUGGESELLSCHAFTEN			
Alaska Air Group, Inc.	24,763	1,713,600	1.0
SkyWest, Inc.	33,498	1,642,407	1.0
		<u>3,356,007</u>	<u>2.0</u>
BAUPRODUKTE			
Masonite International Corp.	15,400	1,841,070	1.1
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
ADT, Inc.	155,870	1,611,696	1.0
Herman Miller, Inc.	46,702	2,232,355	1.3
		<u>3,844,051</u>	<u>2.3</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
AECOM	36,465	2,370,590	1.4
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Regal Beloit Corp.	16,169	2,299,717	1.4
Vertiv Holdings Co.	41,020	1,018,116	0.6
		<u>3,317,833</u>	<u>2.0</u>
MASCHINEN			
Crane Co.	16,371	1,563,267	0.9
Kennametal, Inc.	10,597	397,493	0.2
Oshkosh Corp.	19,922	2,618,548	1.6
Timken Co. (The)	21,490	1,900,790	1.1
Welbilt, Inc.	56,770	1,402,787	0.9
		<u>7,882,885</u>	<u>4.7</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Korn Ferry	31,030	\$ 2,029,672	1.2%
Robert Half International, Inc.	30,792	2,734,022	1.7
		<u>4,763,694</u>	<u>2.9</u>
STRASSE UND SCHIENE			
Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	47,188	2,252,283	1.3
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
GATX Corp.	13,890	1,370,387	0.8
MRC Global, Inc.	106,350	1,142,199	0.7
United Rentals, Inc.	3,004	1,003,216	0.6
		<u>3,515,802</u>	<u>2.1</u>
		<u>37,903,231</u>	<u>22.7</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Comerica, Inc.	33,867	2,658,221	1.6
First Citizens BancShares, Inc./NC - Class A	2,874	2,473,364	1.5
Sterling Bancorp/DE	80,946	2,156,401	1.3
Synovus Financial Corp.	52,546	2,581,060	1.5
Texas Capital Bancshares, Inc.	32,496	2,238,325	1.3
Umpqua Holdings Corp.	74,854	1,428,214	0.9
Webster Financial Corp.	36,638	2,076,642	1.2
Wintrust Financial Corp.	27,260	2,192,249	1.3
Zions Bancorp NA	31,749	1,837,632	1.1
		<u>19,642,108</u>	<u>11.7</u>
KAPITALMÄRKTE			
Moelis & Co.	23,991	1,288,077	0.8
Stifel Financial Corp.	33,345	2,310,142	1.4
		<u>3,598,219</u>	<u>2.2</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
OneMain Holdings, Inc.	20,508	1,186,183	0.7
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Voya Financial, Inc.	23,250	1,523,340	0.9
VERSICHERUNGEN			
American Financial Group, Inc./OH	14,617	1,944,938	1.2
Everest Re Group Ltd.	6,921	1,799,183	1.1
Hanover Insurance Group, Inc. (The)	11,018	1,536,901	0.9
Selective Insurance Group, Inc.	14,438	1,086,748	0.6
		<u>6,367,770</u>	<u>3.8</u>
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG			
BankUnited, Inc.	44,299	2,117,049	1.3
		<u>34,434,669</u>	<u>20.6</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
GCP Applied Technologies, Inc.	52,530	1,280,681	0.8
Innospec, Inc.	9,298	940,121	0.6
Orion Engineered Carbons SA	64,639	1,308,293	0.8
Trinseo SA	24,688	1,603,239	0.9
		<u>5,132,334</u>	<u>3.1</u>
CONTAINER UND VERPACKUNGEN			
Sealed Air Corp.	42,414	2,411,660	1.5
METALL UND BERGBAU			
Carpenter Technology Corp.	46,353	2,221,236	1.3
Commercial Metals Co.	58,990	1,856,415	1.1
Reliance Steel & Aluminum Co.	14,930	2,509,285	1.5
		<u>6,586,936</u>	<u>3.9</u>
		<u>14,130,930</u>	<u>8.5</u>
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
American Campus Communities, Inc.	29,878	1,409,047	0.8
Camden Property Trust	14,443	1,810,863	1.1
Cousins Properties, Inc.	38,008	1,409,717	0.8
CubeSmart	40,394	1,768,853	1.1
MGM Growth Properties LLC - Class A	45,476	1,631,224	1.0
Physicians Realty Trust	82,606	1,497,647	0.9
RLJ Lodging Trust	87,589	1,346,243	0.8
STAG Industrial, Inc.	41,841	1,494,142	0.9
		<u>12,367,736</u>	<u>7.4</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN					
Avnet, Inc.			46,510	\$ 2,049,231	1.2%
Belden, Inc.			29,599	1,497,709	0.9
				<u>3,546,940</u>	<u>2.1</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
Amdocs Ltd.			14,423	1,126,436	0.7
Genpact Ltd.			23,960	1,095,931	0.6
				<u>2,222,367</u>	<u>1.3</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG					
Kulicke & Soffa Industries, Inc.			25,575	1,327,342	0.8
MaxLinear, Inc. - Class A			23,576	896,360	0.6
				<u>2,223,702</u>	<u>1.4</u>
SOFTWARE					
CommVault Systems, Inc.			15,357	1,169,743	0.7
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE					
NCR Corp.			24,442	1,178,104	0.7
				<u>10,340,856</u>	<u>6.2</u>
ENERGIE					
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE					
Dril-Quip, Inc.			31,614	1,060,018	0.6
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Cimarex Energy Co.			24,689	1,672,680	1.0
HollyFrontier Corp.			49,318	1,601,355	1.0
				<u>3,274,035</u>	<u>2.0</u>
				<u>4,334,053</u>	<u>2.6</u>
VERBRAUCHSGÜTER					
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Hain Celestial Group, Inc. (The)			45,093	1,837,991	1.1
Nomad Foods Ltd.			68,665	2,105,955	1.3
				<u>3,943,946</u>	<u>2.4</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
IDACORP, Inc.			19,965	1,955,572	1.1
GASVERSORGUNGSBETRIEBE					
Southwest Gas Holdings, Inc.			16,994	1,121,774	0.7
				<u>3,077,346</u>	<u>1.8</u>
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
MEDNAX, Inc.			84,250	2,694,315	1.6
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
MEDIEN					
Criteo SA (Sponsored ADR)			37,159	1,383,801	0.8
Gesamtanlagen					
(Kosten \$130,700,394).				<u>\$ 164,065,912</u>	<u>98.2%</u>
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	(0.13)%	—		3,388	0.0
Barclays, London(b)	0.01 %	—		1,419,682	0.8
Deutsche Bank, Frankfurt(b)	(0.78)%	—		564	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>1,423,634</u>	<u>0.8</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>1,650,887</u>	<u>1.0</u>
Nettovermögen				<u>\$ 167,140,433</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	2,878	AUD	3,709	06/30/2021	\$	(18,068)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	15,588	EUR	12,749	06/30/2021		(32,588)
						\$	(50,656)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar

EUR – Euro

USD – United States Dollar

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt

REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
A-Living Smart City Services Co., Ltd. - Class H	1,536,250	\$ 7,474,253	0.6%
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	64,303	688,305	0.1
Agile Group Holdings Ltd.	432,000	609,582	0.1
Agricultural Bank of China Ltd. - Class H	38,544,000	15,639,580	1.2
AIA Group Ltd.	226,800	3,026,944	0.2
Alfa SAB de CV - Class A	1,179,438	825,453	0.1
Alibaba Group Holding Ltd.	539,140	14,419,576	1.2
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	26,641	5,700,108	0.4
ANTA Sports Products Ltd.	102,000	2,058,997	0.1
Antofagasta PLC	56,326	1,233,153	0.1
ASE Technology Holding Co., Ltd.	94,000	373,625	0.0
Asustek Computer, Inc.	53,000	747,118	0.1
Baidu, Inc. (Sponsored ADR)	3,220	631,989	0.1
Banco Santander Chile	4,367,904	234,703	0.0
Bank of Beijing Co., Ltd. - Class A	966,900	748,089	0.1
Bank of China Ltd. - Class H	7,543,000	2,858,188	0.3
Bank of Communications Co., Ltd. - Class A	554,400	429,880	0.0
Bank of Communications Co., Ltd. - Class H	6,417,000	4,333,479	0.4
BB Seguridade Participacoes SA	57,300	257,161	0.0
Bilibili, Inc. (Sponsored ADR)	6,468	693,240	0.1
Bupa Arabia for Cooperative Insurance Co.	22,259	707,492	0.1
BYD Co., Ltd.	21,000	482,654	0.0
Cathay Financial Holding Co., Ltd.	1,258,000	2,514,103	0.2
CEZ AS	27,381	818,144	0.1
Cheil Worldwide, Inc.	35,833	772,355	0.1
China Aoyuan Group Ltd.	592,000	694,274	0.1
China Cinda Asset Management Co., Ltd. - Class H	3,182,000	680,456	0.1
China CITIC Bank Corp., Ltd. - Class H	12,712,000	6,948,376	0.6
China Communications Services Corp., Ltd. - Class H	2,060,000	865,313	0.1
China Construction Bank Corp. - Class H	6,939,000	5,717,227	0.4
China Everbright Bank Co., Ltd. - Class H	1,730,000	738,108	0.1
China Everbright Ltd.	136,000	171,408	0.0
China Fortune Land Development Co., Ltd.	704,675	605,804	0.0
China Hongqiao Group Ltd.	3,999,439	6,451,099	0.5
China Medical System Holdings Ltd.	1,840,000	4,592,965	0.4
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H	91,500	846,561	0.1
China Merchants Port Holdings Co., Ltd.	432,000	713,577	0.1
China Minsheng Banking Corp., Ltd. - Class A	831,900	617,602	0.1
China Minsheng Banking Corp., Ltd. - Class H	34,389,100	18,297,160	1.5
China National Building Material Co., Ltd. - Class H	454,000	601,221	0.0
China Railway Group Ltd. - Class H	2,707,000	1,428,968	0.1
China Shenhua Energy Co., Ltd. - Class A	236,700	742,365	0.1
China Shenhua Energy Co., Ltd. - Class H	356,000	786,084	0.1
China Yuchai International Ltd.	148,670	2,375,747	0.2
Cia Siderurgica Nacional SA	93,300	799,147	0.1
CITIC Ltd.	722,000	848,772	0.1
Co. for Cooperative Insurance (The)	33,517	710,513	0.1
Coal India Ltd.	400,880	812,089	0.1
Compal Electronics, Inc.	740,000	621,270	0.1
CPFL Energia SA	119,900	667,402	0.1
CSN Mineracao SA	1,010,100	1,806,346	0.1
Daqin Railway Co., Ltd. - Class A	667,900	727,860	0.1
Dongfeng Motor Group Co., Ltd. - Class H	1,640,000	1,558,445	0.1
Eastern Co. SAE	555,152	425,404	0.0
ElSewedy Electric Co.	825,654	420,152	0.0
Equatorial Energia SA	1,040,700	5,076,001	0.4
Eregli Demir ve Celik Fabrikalari TAS	189,201	424,312	0.0
Evergreen Marine Corp. Taiwan Ltd.	1,463,000	5,077,031	0.4
Exxaro Resources Ltd.	60,877	671,442	0.1
Far East Horizon Ltd. (a)	620,000	679,045	0.1
Fibra Uno Administracion SA de CV	6,614,520	7,754,245	0.7
Ford Otomotiv Sanayi AS	118,157	2,372,589	0.2
Fortescue Metals Group Ltd.	309,464	5,285,126	0.4
Fubon Financial Holding Co., Ltd.	3,173,000	8,231,541	0.7
Fuyao Glass Industry Group Co., Ltd. - Class H	120,800	759,272	0.1
GAIL India Ltd.	6,098,645	12,861,975	1.0
GDS Holdings Ltd. (ADR)	31,641	2,380,036	0.2
Gerdau SA	22,400	118,110	0.0
Globe Telecom, Inc.	9,750	369,418	0.0
Great Wall Motor Co., Ltd.	668,500	1,854,686	0.2
Grupo Mexico SAB de CV	147,669	708,764	0.1
Guangzhou Automobile Group Co., Ltd. - Class H	2,308,000	1,996,067	0.1

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Guangzhou R&F Properties Co., Ltd. - Class H	538,000	\$ 726,293	0.1%
Habib Bank Ltd.	134,599	116,891	0.0
Haci Omer Sabanci Holding AS	2,862,690	2,883,629	0.2
Halyk Savings Bank of Kazakhstan JSC (GDR)	133,910	2,142,560	0.2
Hana Financial Group, Inc.	484,140	19,763,665	1.6
Hanjaya Mandala Sampoerna Tbk PT	6,467,500	576,806	0.0
Hankook Tire & Technology Co., Ltd.	15,732	680,964	0.1
HCL Technologies Ltd.	52,232	678,798	0.1
HDFC Bank Ltd.	301,580	6,256,117	0.5
HeadHunter Group PLC (ADR)	91,910	3,783,935	0.3
Henan Shuanghui Investment & Development Co., Ltd. - Class A	29,500	165,207	0.0
Hero MotoCorp Ltd.	1,362	56,198	0.0
Hindalco Industries Ltd.	2,964,848	15,836,831	1.3
Hindustan Petroleum Corp., Ltd.	221,748	858,397	0.1
Hindustan Zinc Ltd.	167,279	753,121	0.1
Hon Hai Precision Industry Co., Ltd.	4,691,000	18,743,639	1.5
Hopson Development Holdings Ltd.	197,100	956,180	0.1
Housing Development Finance Corp., Ltd.	83,834	2,935,497	0.2
Hunan Valin Steel Co., Ltd. - Class A	576,000	622,788	0.1
Hyundai Mobis Co., Ltd.	17,778	4,431,133	0.3
Hyundai Motor Co.	17,452	3,621,957	0.2
Impala Platinum Holdings Ltd.	37,524	647,969	0.1
Indian Oil Corp. Ltd.	565,859	857,162	0.1
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	247,720	906,773	0.1
Industrial Bank of Korea	71,696	697,063	0.1
Infosys Ltd.	37,049	717,191	0.1
Infosys Ltd. (Sponsored ADR)	235,407	4,552,772	0.3
Inner Mongolia Junzheng Energy & Chemical Industry Group Co., Ltd. - Class A	820,700	734,253	0.1
International Container Terminal Services, Inc.	223,920	684,989	0.1
Itau Unibanco Holding SA	86,000	436,955	0.0
Itaúsa SA (Preference Shares)	1	2	0.0
JBS SA	126,000	728,192	0.1
JD.com, Inc. (ADR)	29,338	2,169,252	0.2
JD.com, Inc. - Class A	452,590	16,689,168	1.3
Jiangxi Copper Co., Ltd. - Class H	4,306,000	10,068,497	0.8
Kasikornbank PCL (Foreign Shares)	276,700	1,062,528	0.1
KB Financial Group, Inc.	144,132	7,384,712	0.5
Kia Corp.	202,967	15,354,218	1.2
Kingboard Holdings Ltd.	118,500	654,978	0.1
KT Corp.	27,861	844,761	0.1
KT&G Corp.	9,541	716,012	0.1
Kumba Iron Ore Ltd.	16,201	721,866	0.1
Kumho Petrochemical Co., Ltd.	3,062	639,907	0.1
KWG Group Holdings Ltd.	415,000	632,145	0.1
Lenovo Group Ltd.	542,000	653,592	0.1
LG Electronics, Inc.	5,012	680,836	0.1
Li Ning Co., Ltd.	167,000	1,535,365	0.1
Lite-On Technology Corp.	305,000	722,393	0.1
Logan Group Co. Ltd.	436,000	698,737	0.1
Lotte Shopping Co., Ltd.	4,418	462,811	0.0
LUKOIL PJSC (Sponsored ADR)	186,219	15,122,845	1.2
Magnit PJSC (Sponsored GDR)	41,014	626,284	0.1
Mahindra & Mahindra Ltd.	66,940	780,356	0.1
MCB Bank Ltd.	162,837	172,552	0.0
MediaTek, Inc.	407,000	14,060,665	1.1
Meituan - Class B	64,500	2,260,705	0.2
Meritz Securities Co., Ltd.	169,258	677,695	0.1
Metropolitan Bank & Trust Co.	4,187,040	4,283,303	0.3
Micro-Star International Co., Ltd.	117,000	699,681	0.1
MMC Norilsk Nickel PJSC (ADR)	45,322	1,606,665	0.1
MultiChoice Group	80,224	795,822	0.1
Naspers Ltd. - Class N	1,691	372,742	0.0
NAVER Corp.	26,254	8,423,438	0.7
NetEase, Inc. (ADR)	12,324	1,453,369	0.1
Network International Holdings PLC	429,388	2,423,303	0.2
New Oriental Education & Technology Group, Inc. (Sponsored ADR)	354,870	3,630,320	0.3
NH Investment & Securities Co., Ltd.	64,892	778,829	0.1
NIO, Inc. (ADR)	18,682	721,499	0.1
Novatek Microelectronics Corp.	433,000	7,863,562	0.6
NTPC Ltd.	504,932	758,313	0.1
Oil & Gas Development Co., Ltd.	232,809	143,889	0.0
OPAP SA	666,581	10,475,970	0.8
Orbia Advance Corp. SAB de CV	550,997	1,554,952	0.1
Parade Technologies Ltd.	20,000	1,080,621	0.1
Pegatron Corp.	276,000	728,128	0.1

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PetroChina Co., Ltd. - Class H	9,892,000	\$ 4,045,058	0.3%
Petroleo Brasileiro SA	167,900	860,489	0.1
Petroleo Brasileiro SA (ADR)	216,160	2,206,994	0.2
Petroleo Brasileiro SA (Preference Shares)	686,100	3,553,128	0.3
Petronas Gas Bhd	114,300	447,964	0.0
Phison Electronics Corp.	42,000	705,632	0.1
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	8,580,000	8,374,721	0.7
Pinduoduo, Inc. (ADR)	4,949	618,031	0.1
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	361,000	3,943,266	0.3
PLDT, Inc.	3,510	96,801	0.0
Polskie Gornictwo Naftowe i Gazownictwo SA	315,653	566,125	0.0
Polyus PJSC (GDR)	499	54,303	0.0
POSCO	31,851	10,187,170	0.8
Power Grid Corp. of India Ltd.	1,165,320	3,623,414	0.2
Quanta Computer, Inc.	201,000	637,125	0.1
REC Ltd.	400,905	808,447	0.1
Refrigeration Electrical Engineering Corp.	1,391,403	3,580,654	0.3
Richter Gedeon Nyrt	64,220	1,792,537	0.1
SAIC Motor Corp., Ltd. - Class A	1,576,400	5,051,858	0.4
Samsonite International SA	1,864,800	3,540,962	0.3
Samsung Electronics Co., Ltd.	441,567	31,695,787	2.6
Samsung Electronics Co., Ltd. (Preference Shares)	146,754	9,494,331	0.8
Sasol Ltd.	33,465	545,676	0.0
Saudi Arabian Oil Co.	68,213	641,479	0.1
Saudi Basic Industries Corp.	6,998	232,552	0.0
Sberbank of Russia PJSC (Sponsored ADR)	726,419	12,265,846	1.0
Shanghai Pudong Development Bank Co., Ltd. - Class A	292,700	476,449	0.0
Shenzhen Overseas Chinese Town Co., Ltd. - Class A	454,100	594,808	0.0
Shoprite Holdings Ltd.	54,894	608,280	0.0
Sibanye Stillwater Ltd.	156,904	715,284	0.1
Sime Darby Bhd	1,220,800	673,382	0.1
Sinbon Electronics Co., Ltd.	296,000	2,789,919	0.2
Sinopharm Group Co., Ltd. - Class H	275,600	919,251	0.1
SK Hynix, Inc.	97,370	10,917,230	0.9
Southern Copper Corp.	9,960	694,610	0.1
State Bank of India	328,519	1,911,574	0.1
Sunny Friend Environmental Technology Co., Ltd.	313,000	2,400,937	0.2
Supermax Corp. Bhd	173,000	177,004	0.0
Synnex Technology International Corp.	359,000	759,445	0.1
Taiwan Cement Corp.	1,469,220	2,680,370	0.2
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	1,465,000	31,105,152	2.5
Tata Consultancy Services Ltd.	7,222	313,047	0.0
TCS Group Holding PLC (GDR)	96,559	7,228,378	0.6
Tencent Holdings Ltd.	411,500	32,171,444	2.6
Tencent Music Entertainment Group (ADR)	37,789	594,799	0.0
Top Glove Corp. Bhd	549,300	675,541	0.1
Tosoh Corp.	320,500	5,698,627	0.4
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class A	391,063	6,452,527	0.5
United Microelectronics Corp.	9,874,000	18,556,921	1.4
Universal Vision Biotechnology Co., Ltd.	269,000	2,961,518	0.2
Vale SA	37,700	807,211	0.1
Vedanta Ltd.	129,601	475,673	0.0
Vincom Retail JSC	1,975,600	2,619,445	0.2
Vipshop Holdings Ltd. (ADR)	23,713	548,482	0.0
Vodacom Group Ltd.	79,296	760,091	0.1
WEG SA	82,000	541,244	0.0
WPG Holdings Ltd.	407,000	756,148	0.1
X5 Retail Group NV (GDR)	47,959	1,433,974	0.1
Xiamen C & D, Inc.	551,500	706,857	0.1
XPeng, Inc. (ADR)	20,305	652,400	0.1
Yadea Group Holdings Ltd.	68,154	148,700	0.0
Yanzhou Coal Mining Co., Ltd.	238,200	499,531	0.0
Yanzhou Coal Mining Co., Ltd. - Class H	566,000	720,704	0.1
Zai Lab Ltd. (ADR)	3,263	579,705	0.0
Zhejiang Expressway Co., Ltd. - Class H	760,000	671,605	0.1
Zhejiang Semir Garment Co., Ltd. - Class A	2,927,400	5,513,420	0.4
Zhen Ding Technology Holding Ltd.	591,000	2,063,554	0.1
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class H	372,000	575,709	0.0
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. - Class H	2,999,600	3,729,439	0.3
		<u>694,361,498</u>	<u>57.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
STAATSANLEIHEN					
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	USD 3,502	\$ 3,563,942	0.3%
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	4,857	5,026,388	0.4
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2030	11,577	4,260,153	0.4
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2035	27,482	9,039,966	0.7
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	01/09/2038	4,841	1,908,741	0.2
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	2,154	835,740	0.1
Bahamas Government International Bond	8.95%	10/15/2032	2,111	2,401,922	0.2
Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031	1,846	1,853,269	0.2
Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044	3,254	3,033,948	0.3
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	1,519	1,660,267	0.1
Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028	2,835	3,170,770	0.3
Brazilian Government International Bond	3.88%	06/12/2030	4,846	4,893,854	0.4
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	1,828	1,756,936	0.1
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	4,500	4,331,250	0.4
Colombia Government International Bond	5.00%	06/15/2045	4,046	4,169,403	0.3
Dominican Republic International Bond	5.30%	01/21/2041	253	253,522	0.0
Dominican Republic International Bond	5.50%	01/27/2025	299	329,423	0.0
Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060	3,822	3,759,892	0.3
Dominican Republic International Bond	6.40%	06/05/2049	756	809,770	0.1
Dominican Republic International Bond	6.50%	02/15/2048	3,736	4,071,773	0.3
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	1,054	593,384	0.0
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2030	4,632	4,006,457	0.3
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2035	6,348	4,436,027	0.4
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	3,558	2,251,602	0.2
Egypt Government International Bond	3.88%	02/16/2026	1,271	1,259,482	0.1
Egypt Government International Bond	5.63%	04/16/2030	EUR 1,602	1,994,828	0.2
Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031	USD 641	629,582	0.1
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	620	647,144	0.1
Egypt Government International Bond	7.50%	02/16/2061	689	658,641	0.1
Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048	2,061	2,084,573	0.2
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	2,498	2,649,129	0.2
Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	1,727	1,856,849	0.2
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	1,824	2,002,182	0.2
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	2,023	1,959,781	0.2
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	2,101	2,056,354	0.2
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	5,383	5,066,749	0.5
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	388	388,970	0.0
El Salvador Government International Bond	7.75%	01/24/2023	1,100	1,120,625	0.1
Finance Department Government of Sharjah	4.00%	07/28/2050	629	573,962	0.0
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	2,758	2,752,484	0.2
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	2,616	2,805,333	0.2
Ghana Government International Bond	7.75%	04/07/2029	715	739,131	0.1
Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027	1,415	1,494,417	0.1
Ghana Government International Bond	7.88%	02/11/2035	2,728	2,714,019	0.2
Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	1,010	1,034,808	0.1
Ghana Government International Bond	8.63%	04/07/2034	434	452,988	0.0
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	3,156	3,076,705	0.3
Ghana Government International Bond	8.75%	03/11/2061	384	372,312	0.0
Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051	2,059	2,049,091	0.2
Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	939	1,028,088	0.1
Honduras Government International Bond	7.50%	03/15/2024	3,788	4,083,464	0.3
Israel Government International Bond	4.50%	04/03/2120	1,542	1,894,763	0.2
Ivory Coast Government International Bond	5.38%	07/23/2024	1,064	1,146,992	0.1
Ivory Coast Government International Bond	5.88%	10/17/2031	EUR 920	1,219,919	0.1
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	USD 3,764	4,004,661	0.3
Ivory Coast Government International Bond	6.63%	03/22/2048	EUR 1,084	1,394,009	0.1
Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	USD 1,746	2,417,664	0.2
Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	1,561	1,731,539	0.1
Lebanon Government International Bond(b)	6.00%	01/27/2023	812	106,981	0.0
Lebanon Government International Bond(b)	6.65%	04/22/2024	1,060	138,993	0.0
Lebanon Government International Bond(b)	6.85%	03/23/2027	5,631	734,845	0.1
Lebanon Government International Bond, Series E(b)	6.10%	10/04/2022	1,371	179,344	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(b)	1.00%	11/27/2026	2,053	270,483	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(b)	6.20%	02/26/2025	2,310	302,177	0.0
Mexico Government International Bond	5.00%	04/27/2051	2,045	2,285,671	0.2
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	2,303	2,449,528	0.2
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	1,585	1,597,185	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	3,376	3,484,243	0.3
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	320	346,260	0.0
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	835	872,732	0.1
Oman Government International Bond	5.63%	01/17/2028	503	525,635	0.0
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	1,512	1,598,940	0.1
Oman Government International Bond	6.50%	03/08/2047	2,286	2,185,702	0.2
Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	3,922	3,821,008	0.3
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	1,550	1,620,041	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Pakistan Government International Bond	8.25%	04/15/2024	USD 200	\$ 218,163	0.0%
Panama Government International Bond	3.16%	01/23/2030	1,700	1,784,256	0.1
Panama Government International Bond	4.50%	04/16/2050	2,577	2,857,732	0.2
Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031	1,869	2,119,329	0.2
Paraguay Government International Bond	5.40%	03/30/2050	736	837,568	0.1
Peruvian Government International Bond	2.78%	12/01/2060	2,045	1,696,455	0.1
Peruvian Government International Bond	2.78%	01/23/2031	5,293	5,298,955	0.4
Peruvian Government International Bond	3.23%	07/28/2121	1,009	835,452	0.1
Qatar Government International Bond	4.40%	04/16/2050	3,641	4,323,687	0.4
Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048	3,617	4,694,866	0.4
Republic of Azerbaijan International Bond	5.13%	09/01/2029	520	578,337	0.0
Republic of South Africa Government International Bond	5.00%	10/12/2046	3,318	3,119,542	0.3
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	1,089	1,094,309	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	2,307	2,321,130	0.2
Russian Foreign Bond - Eurobond	4.38%	03/21/2029	4,600	5,162,062	0.4
Russian Foreign Bond - Eurobond	5.25%	06/23/2047	8,200	10,192,600	0.8
Rwanda International Government Bond	6.63%	05/02/2023	222	235,015	0.0
Saudi Government International Bond	3.25%	10/22/2030	1,293	1,383,106	0.1
Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049	1,428	1,757,779	0.1
Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050	1,859	2,367,088	0.2
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 278	354,644	0.0
Senegal Government International Bond	6.25%	07/30/2024	USD 581	646,108	0.1
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	3,930	3,999,512	0.3
Serbia International Bond	2.13%	12/01/2030	607	566,331	0.0
Sri Lanka Government International Bond	6.20%	05/11/2027	4,972	3,321,296	0.3
Turkey Government International Bond	4.75%	01/26/2026	1,880	1,830,650	0.2
Turkey Government International Bond	4.88%	04/16/2043	2,770	2,154,966	0.2
Turkey Government International Bond	5.75%	05/11/2047	3,186	2,654,934	0.2
Ukraine Government International Bond	6.88%	05/21/2029	1,289	1,344,427	0.1
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2033	1,960	2,058,367	0.2
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	2,016	2,139,228	0.2
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2023	3,711	4,010,431	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2024	284	312,365	0.0
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	6,011	6,697,757	0.6
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	323	358,893	0.0
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2028	300	359,025	0.0
Ukraine Government International Bond, Series GDP(c)	0.00%	05/31/2040	2,685	2,969,946	0.2
Uruguay Government International Bond	4.38%	01/23/2031	1,195	1,386,336	0.1
Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055	193	241,136	0.0
Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050	1,140	1,439,764	0.1
Venezuela Government International Bond(b)	11.95%	08/05/2031	4,466	452,132	0.0
Venezuela Government International Bond(b)	12.75%	08/23/2022	7,624	762,430	0.1
				<u>249,237,514</u>	<u>20.4</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
Absa Group Ltd.(d)	6.38%	05/27/2026	371	378,304	0.0
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	4.00%	10/03/2049	400	448,825	0.0
AES Gener SA	6.35%	10/07/2079	590	625,412	0.1
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	786	805,797	0.1
America Movil SAB de CV	7.13%	12/09/2024	MXN 3,550	180,046	0.0
America Movil SAB de CV, Series 12	6.45%	12/05/2022	6,080	308,171	0.0
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	USD 287	290,102	0.0
Banco de Credito del Peru	3.13%	07/01/2030	695	682,837	0.1
Banco de Credito del Peru	3.25%	09/30/2031	954	939,690	0.1
Banco de Credito del Peru	4.65%	09/17/2024	PEN 970	255,038	0.0
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	3.73%	09/25/2034	USD 1,212	1,237,225	0.1
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.	0.00%	06/05/2034	1,074	796,161	0.1
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	1,904	2,006,340	0.2
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	352	370,462	0.0
Braskem Netherlands Finance BV	5.88%	01/31/2050	872	934,610	0.1
BRF SA	5.75%	09/21/2050	697	693,515	0.1
CapitaMalls Asia Treasury Ltd.	3.70%	08/29/2022	SGD 250	195,948	0.0
Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031	USD 2,097	2,098,311	0.2
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	441	497,586	0.0
Cemig Geracao e Transmissao SA	9.25%	12/05/2024	949	1,094,197	0.1
Central American Bottling Corp.	5.75%	01/31/2027	1,166	1,221,735	0.1
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	1,771	1,451,778	0.1
China Cinda 2020 I Management Ltd.	3.00%	01/20/2031	465	435,298	0.0
China Cinda Finance 2017 I Ltd.	4.40%	03/09/2027	364	388,297	0.0
China Construction Bank Corp./Astana	2.95%	03/19/2022	CNH 1,560	246,040	0.0
Contemporary Ruiding Development Ltd.	2.63%	09/17/2030	USD 1,560	1,536,105	0.1
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023	2,360	2,450,417	0.2
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	3,968	4,687,200	0.4
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	1,505	1,598,122	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	1,212	1,379,155	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	1,212	1,239,611	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	1,331	1,307,841	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Empresas Publicas de Medellin ESP	8.38%	11/08/2027	COP 8,942,000	\$ 2,373,863	0.2%
Enel Americas SA	4.00%	10/25/2026	USD 920	997,797	0.1
Energia Finance AB	2.13%	03/07/2027	EUR 145	185,694	0.0
Energuate Trust	5.88%	05/03/2027	USD 379	394,823	0.0
Frontera Energy Corp.	9.70%	06/25/2023	1,182	1,159,837	0.1
Gerdau Trade, Inc.	4.88%	10/24/2027	1,530	1,727,752	0.1
GNL Quintero SA	4.63%	07/31/2029	1,767	1,933,540	0.2
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.	6.25%	02/15/2025	2,837	2,441,422	0.2
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	970	830,565	0.1
Grupo Energia Bogota SA ESP	4.88%	05/15/2030	795	863,569	0.1
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR 10,000	140,974	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	3.75%	04/27/2022	USD 570	430,350	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	3.80%	11/07/2025	SGD 250	108,400	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	USD 464	306,240	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.25%	11/13/2024	400	274,000	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.75%	05/29/2024	219	149,468	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	4.50%	05/29/2029	1,001	660,660	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026	447	297,255	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.88%	11/22/2026	613	404,772	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.00%	11/19/2025	604	410,909	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	1,843	1,276,277	0.1
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	842	842,000	0.1
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd.	7.13%	10/10/2022	INR 100,000	1,373,503	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	USD 1,412	1,506,692	0.1
Industrial & Commercial Bank of China Ltd./Singapore	3.30%	04/25/2022	CNH 2,040	324,371	0.0
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	3.75%	01/14/2028	USD 3,708	3,970,573	0.3
InterCorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027	2,645	2,644,173	0.2
InterCorp Peru Ltd.	3.88%	08/15/2029	1,011	975,615	0.1
Inversiones CMPC SA	3.85%	01/13/2030	1,015	1,080,214	0.1
Inversiones CMPC SA	4.38%	04/04/2027	453	501,358	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	376	405,423	0.0
Israel Electric Corp., Ltd., Series 6	5.00%	11/12/2024	294	328,821	0.0
Klabin Austria GmbH	3.20%	01/12/2031	1,194	1,152,057	0.1
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	698	670,077	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.75%	06/30/2030	779	879,054	0.1
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	7.25%	05/03/2023	709	735,942	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	674	689,165	0.1
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	1,261	1,450,538	0.1
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	969	1,057,603	0.1
Minsur SA	6.25%	02/07/2024	376	402,884	0.0
National Central Cooling Co. PJSC	2.50%	10/21/2027	569	564,021	0.1
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	2,175	2,367,257	0.2
NTPC Ltd., Series E	7.38%	08/10/2021	INR 10,000	138,041	0.0
OCP SA	5.63%	04/25/2024	USD 1,261	1,374,726	0.1
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	1,214	12,145	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	5.25%	12/27/2033	350	41,079	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	7.13%	12/26/2046	644	75,676	0.0
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	1,089	1,124,066	0.1
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030	2,775	2,180,630	0.2
Petrobras Global Finance BV	6.75%	06/03/2050	730	821,064	0.1
Petrobras Global Finance BV	6.90%	03/19/2049	513	596,551	0.1
Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026	1,044	1,335,211	0.1
PTTEP Treasury Center Co., Ltd.	3.90%	12/06/2059	552	560,729	0.1
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.	0.00%	09/30/2036	780	556,649	0.0
SEPLAT Petroleum Development Co. PLC	7.75%	04/01/2026	1,154	1,188,620	0.1
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	750	777,948	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	3.25%	08/15/2030	860	875,721	0.1
TransJamaican Highway Ltd.	5.75%	10/10/2036	1,344	1,337,435	0.1
Transportadora de Gas Internacional SA ESP	5.55%	11/01/2028	1,642	1,807,534	0.2
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	1,056	1,163,778	0.1
Tullow Oil PLC	10.25%	05/15/2026	1,879	1,935,382	0.2
Türkiye Vakıflar Bankası TAO	6.50%	01/08/2026	1,589	1,604,393	0.1
United Overseas Bank Ltd.	3.50%	02/27/2029	SGD 250	199,669	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	USD 1,084	1,195,342	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	1,860	1,815,592	0.2
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	1,169	1,182,661	0.1
Zorlu Yenilenebilir Enerji AS	9.00%	06/01/2026	1,598	1,550,060	0.1
				<u>99,520,386</u>	<u>8.2</u>
QUASI-STAAITSANLEIHEN					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	6.00%	11/18/2048	2,503	2,690,817	0.2
Agricultural Bank of China Ltd.	3.05%	10/27/2023	CNH 1,070	169,878	0.0
Airport Authority(d)	2.40%	03/08/2028	USD 1,567	1,548,196	0.1
China Development Bank	4.20%	01/19/2027	CNH 1,000	166,485	0.0
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	4.63%	03/14/2023	USD 280	291,340	0.0
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	659	649,115	0.1
Comision Federal de Electricidad	4.68%	02/09/2051	604	568,628	0.1

AB SICAV I
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Comision Federal de Electricidad, Series 17	8.18%	12/23/2027	MXN 4,480	\$ 216,892	0.0%
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031	USD 578	619,183	0.1
DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029	1,315	1,402,119	0.1
DP World PLC	5.63%	09/25/2048	865	1,055,732	0.1
DP World Salaam(d)	6.00%	10/01/2025	1,221	1,343,100	0.1
Empresa de Transmision Electrica SA	5.13%	05/02/2049	1,668	1,822,290	0.2
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	3.65%	05/07/2030	267	285,607	0.0
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	4.70%	05/07/2050	1,550	1,741,316	0.2
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA	5.00%	01/25/2047	200	230,288	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd.	6.35%	08/10/2028	2,505	2,810,610	0.2
Eskom Holdings SOC Ltd.	6.75%	08/06/2023	2,534	2,661,967	0.2
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	3,446	3,650,606	0.3
Eskom Holdings SOC Ltd., Series 42	8.50%	04/25/2042	ZAR 2,000	107,347	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd., Series ES23	10.00%	01/25/2023	4,100	316,472	0.0
Housing & Development Board, Series 083	2.55%	11/20/2023	SGD 250	197,873	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	USD 532	613,396	0.1
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.80%	05/15/2050	892	1,038,232	0.1
KazMunayGas National Co. JSC	5.38%	04/24/2030	1,930	2,299,595	0.2
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.38%	07/19/2022	1,323	1,352,177	0.1
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2026	974	986,358	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	1,864	2,092,107	0.2
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.63%	11/07/2024	1,970	2,209,232	0.2
Pertamina Persero PT	4.15%	02/25/2060	1,200	1,171,725	0.1
Pertamina Persero PT	5.63%	05/20/2043	425	488,564	0.0
Pertamina Persero PT	6.00%	05/03/2042	2,190	2,628,000	0.2
Pertamina Persero PT	6.45%	05/30/2044	1,084	1,372,479	0.1
Pertamina Persero PT	6.50%	05/27/2041	711	901,992	0.1
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara	3.38%	02/05/2030	4,012	4,080,455	0.3
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara	3.88%	07/17/2029	1,174	1,235,488	0.1
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara	5.45%	05/21/2028	209	242,218	0.0
Petroleos de Venezuela SA(b)	5.38%	04/12/2027	3,704	166,662	0.0
Petroleos de Venezuela SA(b)	6.00%	11/15/2026	5,448	239,712	0.0
Petroleos de Venezuela SA(b)	9.00%	11/17/2021	2,963	130,365	0.0
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	1,515	1,473,337	0.1
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	4,045	3,574,566	0.3
Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030	1,507	1,558,072	0.1
Petroleos Mexicanos	6.88%	08/04/2026	850	939,106	0.1
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	6,729	5,911,426	0.5
Petroleos Mexicanos	7.19%	09/12/2024	MXN 8,420	398,373	0.0
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	USD 2,009	1,934,667	0.2
Petroleos Mexicanos, Series 14-2	7.47%	11/12/2026	MXN 10,740	472,248	0.0
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd	2.70%	05/13/2030	USD 2,090	2,115,211	0.2
Southern Gas Corridor CJSC	6.88%	03/24/2026	705	847,058	0.1
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic	6.95%	03/18/2030	2,375	2,958,805	0.2
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025	564	606,554	0.1
Trinidad Generation UnLtd	5.25%	11/04/2027	1,492	1,529,113	0.1
				<u>72,113,154</u>	<u>5.9</u>
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE					
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2023	BRL 2,061	413,456	0.0
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2029	869	176,283	0.0
Egypt Government Bond, Series 10YR	16.10%	05/07/2029	EGP 1,900	124,411	0.0
Egypt Government Bond, Series 5YR	14.06%	01/12/2026	74,470	4,574,079	0.4
Egypt Government Bond, Series 7Y	14.22%	10/15/2026	3,000	188,468	0.0
Egypt Government Bond, Series 7Y	14.29%	01/05/2028	40,519	2,467,550	0.2
Republic of South Africa Government Bond, Series 2030	8.00%	01/31/2030	ZAR 104,786	7,183,825	0.6
Republic of South Africa Government Bond, Series 2032	8.25%	03/31/2032	2,764	181,600	0.0
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048	8.75%	02/28/2048	2,502	151,423	0.0
Republic of South Africa Government Bond, Series R213	7.00%	02/28/2031	7,890	489,151	0.1
				<u>15,950,246</u>	<u>1.3</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
AB SICAV I - China A Shares Equity Portfolio - Class S			473,704	<u>15,518,627</u>	<u>1.3</u>
SCHATZOBLIGATIONEN					
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	2.80%	10/01/2033	CLP 40,000	46,063	0.0
Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP 492,000	127,457	0.0
Colombian TES, Series B	7.50%	08/26/2026	423,600	122,135	0.0
Colombian TES, Series B	10.00%	07/24/2024	796,500	247,562	0.0
Indonesia Treasury Bond, Series FR56	8.38%	09/15/2026	IDR 314,000	24,696	0.0
Indonesia Treasury Bond, Series FR65	6.63%	05/15/2033	1,353,000	93,768	0.0
Indonesia Treasury Bond, Series FR68	8.38%	03/15/2034	2,562,000	198,629	0.0
Malaysia Government Bond, Series 0217	4.06%	09/30/2024	MYR 1,250	318,585	0.0
Malaysia Government Bond, Series 0218	3.76%	04/20/2023	950	237,126	0.0
Malaysia Government Bond, Series 0413	3.84%	04/15/2033	1,345	325,934	0.1
Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047	MXN 85,374	4,464,422	0.4
Peru Government Bond	5.40%	08/12/2034	PEN 120	31,272	0.0
Peru Government Bond	5.94%	02/12/2029	10,093	2,954,866	0.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte/ Nennwert (-)/(000)		Wert (USD)	Nettover- mögen %
Peru Government Bond	6.90%	08/12/2037	PEN	755	\$ 217,413	0.0%
Peru Government Bond	6.95%	08/12/2031		530	162,518	0.0
Peru Government Bond	8.20%	08/12/2026		620	204,375	0.0
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212.	7.05%	01/19/2028	RUB	17,169	237,848	0.0
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6215.	7.00%	08/16/2023		37,560	522,598	0.1
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6222.	7.10%	10/16/2024		21,840	305,077	0.0
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6228.	7.65%	04/10/2030		176,919	2,527,172	0.2
					<u>13,369,516</u>	<u>1.1</u>
AKTIENANLEIHEN						
FPT Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 04/05/2023				2,980,030	12,258,389	1.0
REGIONALANLEIHEN						
Provincia de Neuquen Argentina	2.50%	04/27/2030	USD	760	427,960	0.0
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE						
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series B	6.00%	08/15/2050	BRL	100	24,130	0.0
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP	500,000	116,938	0.0
					<u>141,068</u>	<u>0.0</u>
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN						
SWAPTIONS						
CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index, Morgan Stanley & Co. International PLC Expiration: Jun 2021, Exercise Rate:	1.07%			70,431	50,293	0.0
CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index, Morgan Stanley & Co. International PLC Expiration: Jun 2021, Exercise Rate:	1.07%			31,120	22,222	0.0
					<u>72,515</u>	<u>0.0</u>
					<u>1,172,970,873</u>	<u>96.2</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
STAMMAKTIE						
Tata Steel Ltd.(f)				224	3,410,800	0.3
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
Digicel Group Holdings Ltd.(d) (e)	7.00%	06/14/2021	USD	254	190,801	0.0
Digicel Group Holdings Ltd.(e)	8.00%	04/01/2025		1,547	1,299,270	0.1
Digicel Group Holdings Ltd.(e)	10.00%	04/01/2024		1,251	1,228,876	0.1
Tonon Luxembourg SA(b) (e) (f)	6.50%	10/31/2024		541	5,461	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(g)	10.88%	01/13/2020		1,077	366,180	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(b)	11.75%	02/09/2022		1,240	6,184	0.0
					<u>3,096,772</u>	<u>0.2</u>
STAATSANLEIHEN						
Ukraine Government International Bond	6.75%	06/20/2026	EUR	745	996,955	0.1
SCHATZOBLIGATIONEN						
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6226.	7.95%	10/07/2026	RUB	5,964	86,205	0.0
					<u>7,590,732</u>	<u>0.6</u>
Gesamtanlagen					<u>\$ 1,180,561,605</u>	<u>96.8%</u>
Termineinlagen						
(Kosten \$1,032,062,661)						
BNP Paribas, Paris (i)	(0.13)%	—			1,266,298	0.1
BNP Paribas, Paris (i)	0.00 %	—			19,876	0.0
BNP Paribas, Paris (i)	0.01 %	—			109	0.0
BNP Paribas, Paris (i)	2.99 %	—			960,247	0.1
Credit Suisse AG, Zurich(i)	(1.44)%	—			11,078	0.0
DBS Bank Ltd, Singapore(i)	0.01 %	—			20,275,394	1.7
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong (i)	0.00 %	—			6,480	0.0
Nordea Bank Abp, Oslo (i)	(0.13)%	—			5,580	0.0
Royal Bank of Canada, Toronto(i)	0.01 %	—			4,619	0.0
SEB, Stockholm (i)	(0.28)%	—			1,355	0.0
Sumitomo, London(i)	(0.29)%	—			46,937	0.0
Sumitomo, London(i)	0.01 %	—			230	0.0
Termineinlagen insgesamt					<u>22,598,203</u>	<u>1.9</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					<u>15,934,496</u>	<u>1.3</u>
Nettovermögen					<u>\$ 1,219,094,304</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
MSCI Emerging Markets Index Futures	06/18/2021	1,394	\$ 92,776,396	\$ 94,854,730	\$ 2,078,334
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2021	50	7,231,250	7,247,656	(16,406)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2021	25	4,645,117	4,631,250	13,867
					<u>\$ 2,075,795</u>
				Wertsteigerung	\$ 2,092,201
				Wertminderung	\$ (16,406)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	BRL 668	USD 128	06/02/2021	\$ (424)
Bank of America, NA	USD 247	BRL 1,300	06/02/2021	2,779
Bank of America, NA	PLN 695	USD 182	06/24/2021	(7,067)
Bank of America, NA	USD 21,366	RUB 1,587,406	07/28/2021	128,665
Barclays Bank PLC	USD 3,324	MXN 67,149	06/18/2021	40,631
Barclays Bank PLC	USD 643	CNH 4,194	06/24/2021	15,425
Barclays Bank PLC	INR 9,086	USD 124	07/15/2021	(703)
Barclays Bank PLC	USD 285	IDR 4,194,511	07/15/2021	7,415
Barclays Bank PLC	KRW 110,919,989	USD 99,343	07/22/2021	(226,887)
Barclays Bank PLC	USD 123	KRW 137,382	07/22/2021	222
Barclays Bank PLC	USD 11,443	PHP 562,224	07/22/2021	283,945
Barclays Bank PLC	MYR 18,003	USD 4,331	09/23/2021	(11,511)
Barclays Bank PLC	MYR 33,895	USD 8,198	09/23/2021	21,335
Barclays Bank PLC	USD 297	MYR 1,231	09/23/2021	(508)
BNP Paribas SA	CNH 1,472	USD 225	06/24/2021	(5,636)
BNP Paribas SA	CZK 178,299	USD 8,156	06/24/2021	(383,118)
BNP Paribas SA	PLN 35,652	USD 9,239	06/24/2021	(459,821)
BNP Paribas SA	USD 184	CZK 3,969	06/24/2021	6,423
BNP Paribas SA	COP 980,888	USD 261	07/15/2021	(2,859)
BNP Paribas SA	USD 506	SGD 675	08/19/2021	3,990
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD 198	USD 151	06/04/2021	(1,723)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 152	AUD 198	06/04/2021	953
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 188	ZAR 2,669	06/17/2021	5,113
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR 4,797	USD 329	06/17/2021	(18,488)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN 80,180	USD 4,006	06/18/2021	(12,056)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 73	MXN 1,457	06/18/2021	(355)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 258	MXN 5,170	06/18/2021	869
Brown Brothers Harriman & Co.	CZK 1,379	USD 62	06/24/2021	(3,737)
Brown Brothers Harriman & Co.	HUF 74,181	USD 240	06/24/2021	(19,585)
Brown Brothers Harriman & Co.	PLN 1,623	USD 431	06/24/2021	(10,679)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 22	CNH 140	06/24/2021	212
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 306	CZK 6,622	06/24/2021	11,060
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 552	HUF 165,456	06/24/2021	27,042
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 856	PLN 3,244	06/24/2021	26,401
Brown Brothers Harriman & Co.	THB 76,463	USD 2,439	07/15/2021	(7,257)
Brown Brothers Harriman & Co.	THB 296,455	USD 9,501	07/15/2021	15,356
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 18,471	THB 575,659	07/15/2021	(52,135)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 53,099	USD 488	08/19/2021	3,969
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 31	HKD 243	08/19/2021	20
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,876	CNH 31,716	06/07/2021	102,441
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 37,679	SGD 50,054	06/07/2021	169,108
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 85,050	AUD 109,618	06/30/2021	(534,548)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 15,930	CAD 19,301	06/30/2021	46,181
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 131	CHF 118	06/30/2021	(397)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 39,486	EUR 32,293	06/30/2021	(84,261)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 62,409	GBP 44,115	06/30/2021	198,090
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 156	JPY 16,956	06/30/2021	(1,278)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 16,547	ZAR 229,685	06/30/2021	57,971
Citibank, NA	USD 12,250	BRL 64,662	07/02/2021	121,634
Citibank, NA	COP 39,067,890	USD 10,400	07/15/2021	(109,596)
Citibank, NA	PEN 41,980	USD 11,486	07/15/2021	444,272
Citibank, NA	USD 87	COP 326,463	07/15/2021	916
Citibank, NA	TWD 574,998	USD 20,777	07/22/2021	(122,083)
Credit Suisse International	CNH 705,481	USD 107,894	06/24/2021	(2,874,500)
Deutsche Bank AG	HUF 2,564,062	USD 8,330	06/24/2021	(646,290)
Deutsche Bank AG	USD 22,959	INR 1,708,589	07/15/2021	461,588
Goldman Sachs Bank USA	BRL 112,193	USD 21,122	06/02/2021	(405,647)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Goldman Sachs Bank USA	USD 5,274	BRL 28,340	06/02/2021	\$ 163,538
Goldman Sachs Bank USA	USD 20,940	BRL 111,542	07/02/2021	400,230
Goldman Sachs Bank USA	USD 19	COP 71,743	07/15/2021	(49)
Goldman Sachs Bank USA	TWD 2,925,232	USD 104,294	07/22/2021	(2,026,743)
Goldman Sachs Bank USA	EUR 10,474	USD 12,786	08/03/2021	(2,389)
HSBC Bank USA	USD 9,278	IDR 137,197,339	07/15/2021	272,766
HSBC Bank USA	USD 25,067	EUR 20,434	08/03/2021	(118,027)
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR 8,863,606	USD 600	07/15/2021	(17,257)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 263	ZAR 3,855	06/17/2021	16,446
Morgan Stanley Capital Services LLC	MXN 184,081	USD 9,234	06/18/2021	9,790
Morgan Stanley Capital Services LLC	CLP 6,570,963	USD 9,246	07/15/2021	180,178
Morgan Stanley Capital Services LLC	INR 7,739	USD 105	07/15/2021	(1,089)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 72	CLP 51,315	07/15/2021	(1,407)
Royal Bank of Scotland PLC	BRL 198	USD 36	06/02/2021	(1,447)
Royal Bank of Scotland PLC	USD 15,879	BRL 82,896	06/02/2021	26,812
Royal Bank of Scotland PLC	CNH 746	USD 116	06/24/2021	(1,385)
Royal Bank of Scotland PLC	USD 6,090	KRW 6,807,508	07/22/2021	21,238
Standard Chartered Bank	USD 97	BRL 524	06/02/2021	4,004
Standard Chartered Bank	USD 8,529	ZAR 119,768	06/17/2021	144,711
Standard Chartered Bank	USD 42,547	INR 3,153,711	07/15/2021	682,131
Standard Chartered Bank	PHP 259,932	USD 5,400	07/22/2021	(21,588)
Standard Chartered Bank	TWD 902,357	USD 32,594	07/22/2021	(203,366)
Standard Chartered Bank	USD 366	KRW 407,637	07/22/2021	328
Standard Chartered Bank	USD 28,007	PHP 1,349,362	07/22/2021	137,438
State Street Bank & Trust Co.	ZAR 309,203	USD 21,070	06/17/2021	(1,322,508)
State Street Bank & Trust Co.	HUF 91,354	USD 304	06/24/2021	(15,405)
UBS AG	USD 16,977	CNH 109,434	06/24/2021	205,268
UBS AG	USD 122	CZK 2,621	06/24/2021	3,511
UBS AG	USD 115	RUB 8,536	07/28/2021	930
				\$ (5,262,464)
			Wertsteigerung	\$ 4,473,345
			Wertminderung	\$ (9,735,809)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

VERKAUFTE CREDIT-DEFAULT-SWAPTIONS

Referenz-Obligation	Gegenpartei	Kauf-/Ver- kaufsschutz	Ausübungs- kurs	Fälligkeit	Nominal- betrag (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Call - CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	Morgan Stanley & Co. International PLC	Sell	1.10%	Jun 2021	USD 70,431	\$ 172,555	\$ (71,162)
Call - CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	Morgan Stanley & Co. International PLC	Sell	1.10%	Jun 2021	31,120	68,464	(31,443)
Put - CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	Morgan Stanley & Co. International PLC	Sell	1.05%	Jun 2021	70,431	246,509	(34,591)
Put - CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	Morgan Stanley & Co. International PLC	Sell	1.05%	Jun 2021	31,120	99,584	(15,284)
						\$ 587,112	\$ (152,480)

ZENTRAL ABGERECHNETE INFLATIONSSWAPS (CPI)

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 9,650	05/21/2031	CPI#	2.645%	\$ 78,408
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 3,240	02/22/2051	CPI#	2.341%	(151,013)
Insgesamt					\$ (72,605)
				Wertsteigerung	\$ 78,408
				Wertminderung	\$ (151,013)

Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.

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-EM Series 35, 5 Year Index	06/20/2026	USD 170,490	\$ 4,931,423	\$ (737,000)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 10,470	05/21/2031	1.645%	3 Month LIBOR	\$ (58,411)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	10,260	09/16/2049	3 Month LIBOR	1.836%	(447,460)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group).	5,090	02/22/2051	1.860%	3 Month LIBOR	171,454
Insgesamt					<u>\$ (334,417)</u>
				Wertsteigerung	\$ 171,454
				Wertminderung	\$ (505,871)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nomineller Betrag (000)	Markt- wert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Morgan Stanley & Co. International PLC	Ukraine International Bond	06/20/2025	USD 522	\$ (55,698)	\$ (116,479)	\$ 60,781

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	154,975	LIBOR Plus 0.48%	USD 98,597	11/15/2021	\$ 3,496,236
MSCI Emerging Markets Growth	33,066	LIBOR Plus 0.46%	21,037	05/16/2022	745,969
Insgesamt					<u>\$ 4,242,205</u>

VARIANZ-SWAP

Swap-Kontrahent & Referenz-Obligation	Volatilitäts- Ausübungskurs	Zahlungs- frequenz	Nomineller Betrag (000)		Marktwert	Vorabgebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte							
Bank of America, NA							
Euro STOXX 50 Price EUR Index 08/20/2021*	23.55%	Maturity	EUR	20	\$ (73,387)	\$ —	\$ (73,387)
FTSE 100 Index	23.60	Maturity	GBP	68	(723,776)	—	(723,776)
Russell 2000 Index 06/18/2021*	33.80	Maturity	USD	25	(251,778)	—	(251,778)
UBS AG							
FTSE 100 Index 08/20/2021*	21.90%	Maturity	GBP	17	(42,551)	—	(42,551)
Nikkei 225 Index 08/13/2021*	24.35	Maturity	JPY	8,368	(199,415)	—	(199,415)
S&P/ASX 200 Index 08/19/2021*	18.95	Maturity	AUD	113	(161,923)	—	(161,923)
Verkaufskontrakte							
UBS AG							
FTSE 100 Index 06/18/2021*	16.10	Maturity	GBP	46	117,462	—	117,462
Russell 2000 Index 06/18/2021*	27.20	Maturity	USD	20	100,506	—	100,506
					<u>\$ (1,234,862)</u>	<u>\$ —</u>	<u>\$ (1,234,862)</u>
						Wertsteigerung	\$ 217,968
						Wertminderung	\$ (1,452,830)
Swaps insgesamt							<u>\$ 1,924,102</u>

* Abschlussdatum.

- (a) Stellt sämtliche oder einen Teil der verliehenen Wertpapiere dar. Informationen zur Wertpapierleihe finden Sie in Anmerkung L.
- (b) Not leidend.
- (c) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. Mai 2021.
- (d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (e) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (f) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.
- (g) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (h) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.
- (i) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
BRL	– Brazilian Real
CAD	– Canadian Dollar
CLP	– Chilean Peso
CHF	– Swiss Franc
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
PEN	– Peruvian Sol
PHP	– Philippine Peso
PLN	– Polish Zloty
RUB	– Russian Ruble
SGD	– Singapore Dollar
THB	– Thailand Baht
TWD	– New Taiwan Dollar
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

ABS	– Asset-Backed Securities
ADR	– American Depositary Receipt
ASX	– Australian Stock Exchange
CBT	– Chicago Board of Trade
CJSC	– Closed Joint Stock Company
CME	– Chicago Mercantile Exchange
CPI	– Consumer Price Index
FTSE	– Financial Times Stock Exchange
GDR	– Global Depositary Receipt
INTRCONX	– Inter-Continental Exchange
JSC	– Joint Stock Company
LCH	– London Clearing House
LIBOR	– London Interbank Offered Rate
MSCI	– Morgan Stanley Capital International
PJSC	– Public Joint Stock Company

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
CHINA					
Agricultural Development Bank of China, Series 1705	3.85%	01/06/2027	CNY 30,000	¥ 30,690,944	0.6%
Agricultural Development Bank of China, Series 2004	2.96%	04/17/2030	104,000	99,411,886	1.8
Agricultural Development Bank of China, Series 2005	2.25%	04/22/2025	70,000	67,221,847	1.2
Agricultural Development Bank of China, Series 2103	3.35%	03/24/2026	20,000	20,082,734	0.4
China Development Bank	1.63%	10/27/2030	USD 2,900	17,616,839	0.3
China Development Bank, Series 1710	4.04%	04/10/2027	CNY 40,000	41,345,246	0.8
China Development Bank, Series 1806	4.73%	04/02/2025	50,000	52,676,276	1.0
China Development Bank, Series 1810	4.04%	07/06/2028	156,000	161,582,268	3.0
China Development Bank, Series 1903	3.30%	02/01/2024	100,000	100,519,977	1.9
China Development Bank, Series 1905	3.48%	01/08/2029	160,000	159,892,458	3.0
China Development Bank, Series 1909	3.50%	08/13/2026	99,000	99,755,892	1.8
China Development Bank, Series 2003	3.23%	01/10/2025	150,000	150,188,382	2.8
China Development Bank, Series 2004	3.43%	01/14/2027	80,000	80,195,351	1.5
China Development Bank, Series 2010	3.09%	06/18/2030	120,000	115,874,333	2.1
China Development Bank, Series 2012	3.34%	07/14/2025	160,000	160,500,178	3.0
China Development Bank, Series 2105	3.66%	03/01/2031	20,000	20,224,416	0.4
China Huadian Overseas Development 2018 Ltd.(a)	3.38%	06/23/2025	USD 3,502	22,844,844	0.4
China Huadian Overseas Development Management Co., Ltd.(a)	4.00%	05/29/2024	1,185	7,845,655	0.1
China Huaneng Group Hong Kong Treasury Management Holding Ltd.(a)	3.08%	12/09/2025	8,165	52,685,324	1.0
China Southern Power Grid International Finance BVI 2018 Co., Ltd.	4.25%	09/18/2028	1,130	8,063,475	0.2
Chinalco Capital Holdings Ltd.	4.00%	08/25/2021	3,600	23,004,515	0.4
Chinalco Capital Holdings Ltd.(a)	4.10%	09/11/2024	6,700	44,161,155	0.8
Chinalco Capital Holdings Ltd.	4.25%	04/21/2022	1,050	6,797,342	0.1
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	3.88%	06/19/2029	1,230	7,750,147	0.1
CNAC HK Finbridge Co., Ltd.	5.13%	03/14/2028	900	6,152,004	0.1
CNPC Global Capital Ltd.	2.00%	06/23/2030	3,570	21,570,515	0.4
Dianjian Haiyu Ltd.(a)	3.45%	09/29/2025	2,000	12,789,831	0.2
Dianjian Haiyu Ltd.(a)	3.50%	06/14/2022	500	3,208,991	0.1
Dianjian Haiyu Ltd.(a)	4.30%	06/20/2024	1,077	7,079,210	0.1
Export-Import Bank of China (The)	4.15%	06/18/2027	CNH 30,000	31,921,875	0.6
Export-Import Bank of China (The), Series 2007	3.26%	02/24/2027	CNY 40,000	39,543,382	0.7
Export-Import Bank of China (The), Series 2013	3.34%	09/04/2023	120,000	120,352,343	2.2
JIC Zhixin Ltd.	1.50%	08/27/2025	USD 593	3,711,407	0.1
JIC Zhixin Ltd.	2.13%	08/27/2030	1,100	6,631,066	0.1
King Power Capital Ltd.	5.63%	11/03/2024	800	5,778,649	0.1
Leader Goal International Ltd.(a)	4.25%	01/19/2023	2,437	15,810,228	0.3
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.(a)	3.38%	09/03/2024	2,055	13,291,110	0.2
Minmetals Bounteous Finance BVI Ltd.	4.20%	07/27/2026	700	4,897,638	0.1
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd.	2.70%	05/13/2030	4,610	29,687,731	0.6
SPIC 2018 USD Senior Perpetual Bond Co., Ltd.(a)	5.80%	05/21/2022	200	1,319,786	0.0
SPIC Luxembourg Latin America Renewable Energy Investment Co. SARL	4.65%	10/30/2023	1,190	8,137,270	0.2
Sunny Express Enterprises Corp.	3.13%	04/23/2030	2,824	18,306,320	0.3
Sunny Express Enterprises Corp.(a)	3.35%	10/23/2022	1,319	8,562,361	0.2
				<u>1,909,683,201</u>	<u>35.3</u>
HONGKONG					
Airport Authority(a)	2.40%	03/08/2028	9,150	57,523,696	1.1
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	643	4,465,843	0.1
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	2,094	15,362,954	0.3
Majapahit Holding BV	7.88%	06/29/2037	1,000	8,810,110	0.2
Pelabuhan Indonesia II PT	4.25%	05/05/2025	1,600	11,092,792	0.2
Pertamina Persero PT	3.10%	08/27/2030	1,200	7,784,883	0.1
Pertamina Persero PT	4.18%	01/21/2050	1,000	6,350,374	0.1
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara	4.13%	05/15/2027	1,250	8,590,185	0.1
				<u>62,457,141</u>	<u>1.1</u>
				<u>2,029,664,038</u>	<u>37.5</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	3.73%	09/25/2034	520	3,377,677	0.1
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	9.03%	03/15/2029	1,000	8,708,698	0.2
Bank Mandiri Persero Tbk PT	3.75%	04/11/2024	1,000	6,754,033	0.1
Bank Mandiri Persero Tbk PT	4.75%	05/13/2025	900	6,347,073	0.1
Bank of China Ltd./Hong Kong	4.45%	11/20/2021	CNH 10,000	10,095,625	0.2
Bank of East Asia Ltd. (The)	4.00%	05/29/2030	USD 3,265	21,720,808	0.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
China Construction Bank Corp.	2.45%	06/24/2030	USD 1,955	¥ 12,675,347	0.2%
CITIC Ltd.	3.70%	06/14/2026	725	4,973,081	0.1
CITIC Ltd.	4.00%	01/11/2028	2,140	14,853,631	0.3
CITIC Ltd., Series E	2.85%	02/25/2030	970	6,177,222	0.1
DBS Group Holdings Ltd., Series G(a)	3.30%	02/27/2025	1,045	6,790,740	0.1
HSBC Bank China Co., Ltd.	3.60%	04/01/2024	CNY 10,000	10,075,631	0.2
Industrial & Commercial Bank of China Ltd.	4.88%	09/21/2025	USD 800	5,700,701	0.1
Industrial & Commercial Bank of China Ltd./Singapore	4.50%	10/22/2021	CNH 5,000	5,043,125	0.1
Industrial & Commercial Bank of China Macau Ltd.	2.88%	09/12/2029	USD 1,950	12,898,938	0.2
Kookmin Bank(a)	4.35%	07/02/2024	3,000	20,145,335	0.4
Nanyang Commercial Bank Ltd.	3.80%	11/20/2029	2,800	18,488,146	0.3
Shinhan Financial Group Co., Ltd.(a)	5.88%	08/13/2023	600	4,108,494	0.1
Woori Bank	5.13%	08/06/2028	200	1,481,317	0.0
				<u>180,415,622</u>	<u>3.3</u>
MAKLER					
China Cinda Finance 2017 I Ltd.	4.40%	03/09/2027	567	3,848,703	0.1
China Cinda Finance 2017 I Ltd.	4.75%	02/08/2028	1,000	6,825,618	0.1
CICC Hong Kong Finance 2016 MTN Ltd.	2.00%	01/26/2026	5,770	36,398,056	0.6
Guotai Junan International Holdings Ltd.	2.00%	03/03/2026	1,500	9,528,272	0.2
				<u>56,600,649</u>	<u>1.0</u>
FINANZEN					
Azure Nova International Finance Ltd.	4.25%	03/21/2027	2,311	16,350,272	0.3
BOC Aviation Ltd.	3.00%	09/11/2029	2,353	15,054,722	0.3
BOC Aviation Ltd.	3.25%	04/29/2025	650	4,344,884	0.1
BOC Aviation Ltd.	3.50%	01/31/2023	900	5,926,512	0.1
BOC Aviation Ltd.	3.88%	04/27/2026	2,070	14,268,977	0.3
CCBL Cayman 1 Corp. Ltd.	3.50%	05/16/2024	2,430	16,425,498	0.3
CDBL Funding 1	4.25%	12/02/2024	2,500	17,346,698	0.3
CDBL Funding 2	2.00%	03/04/2026	2,335	14,786,070	0.3
China Development Bank Financial Leasing Co., Ltd.	2.88%	09/28/2030	9,755	62,658,621	1.2
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	600	2,519,788	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	2.50%	02/24/2023	1,374	6,076,315	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.25%	11/13/2024	1,426	6,215,540	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.38%	05/29/2022	1,269	6,096,454	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.75%	05/29/2024	1,550	6,731,364	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	3.63%	11/22/2021	1,900	10,397,305	0.2
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026	1,000	4,231,462	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	2,000	8,812,893	0.2
ICBCIL Finance Co., Ltd.	1.75%	08/25/2025	1,300	8,234,806	0.1
ICBCIL Finance Co., Ltd.	3.63%	05/19/2026	500	3,416,189	0.1
ICBCIL Finance Co., Ltd.	3.63%	11/15/2027	1,535	10,547,526	0.2
Power Finance Corp. Ltd.	3.95%	04/23/2030	645	4,197,314	0.1
PTT Treasury Center Co., Ltd.	5.88%	08/03/2035	500	4,044,394	0.1
SIHC International Capital Ltd.	3.95%	09/26/2021	250	1,603,359	0.0
Soar Wise Ltd.(a)	3.45%	10/23/2022	600	3,838,206	0.1
Xingsheng BVI Co., Ltd.	4.50%	09/20/2021	1,300	8,330,344	0.1
				<u>262,455,513</u>	<u>4.9</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
China Cinda 2020 I Management Ltd.	3.00%	01/20/2031	794	4,729,586	0.1
REITS					
Champion MTN Ltd.	2.95%	06/15/2030	2,325	14,687,414	0.3
Country Garden Holdings Co., Ltd.	4.75%	09/28/2023	1,100	7,158,225	0.1
Elect Global Investments Ltd.(a)	4.10%	06/03/2025	1,115	7,191,524	0.1
Franshion Brilliant Ltd.	4.25%	07/23/2029	4,457	28,007,768	0.5
Hongkong Land Finance Cayman Islands Co., Ltd. (The)	2.88%	05/27/2030	529	3,484,070	0.1
Hysan MTN Ltd.	2.82%	09/04/2029	950	6,127,307	0.1
Powerchina Real Estate Group Ltd.	4.50%	12/06/2021	1,400	9,012,102	0.1
Shimao Group Holdings Ltd.	3.45%	01/11/2031	2,200	13,281,640	0.2
Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd.	3.25%	05/05/2026	1,650	10,357,150	0.2
Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd.	4.75%	08/05/2029	1,640	10,567,884	0.2
Sino-Ocean Land Treasure IV Ltd.	5.25%	04/30/2022	615	4,009,882	0.1
Sun Hung Kai Properties Capital Market Ltd.	2.75%	05/13/2030	730	4,741,601	0.1
Swire Properties MTN Financing Ltd.	3.50%	01/10/2028	600	4,082,247	0.1
Vanke Real Estate Hong Kong Co., Ltd.	3.85%	06/13/2022	CNH 10,000	10,080,625	0.2
Westwood Group Holdings Ltd.	2.80%	01/20/2026	USD 3,150	20,264,515	0.4
				<u>153,053,954</u>	<u>2.8</u>
				<u>657,255,324</u>	<u>12.1</u>
INDUSTRIE GRUNDSTOFFE					
Bluestar Finance Holdings Ltd.(a)	6.25%	11/07/2021	1,400	9,021,364	0.2
Jiangxi Railway & Aviation Investment Group Co., Ltd.	4.85%	02/21/2022	400	2,596,622	0.1
Wealthy Vision Holdings	3.30%	06/01/2024	2,964	18,783,609	0.3
				<u>30,401,595</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
INVESTITIONSGÜTER					
Sepco Virgin Ltd.(a)	3.55%	10/25/2024	USD 4,550	¥ 29,373,720	0.5%
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Tencent Holdings Ltd.	2.39%	06/03/2030	3,640	22,855,860	0.4
Tencent Holdings Ltd.	3.24%	06/03/2050	1,509	8,871,126	0.2
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	3,305	21,275,803	0.4
Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024	1,414	9,482,691	0.2
				<u>62,485,480</u>	<u>1.2</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
HKT Capital No. 4 Ltd.	3.00%	07/14/2026	2,310	15,574,256	0.3
HKT Capital No. 5 Ltd.	3.25%	09/30/2029	835	5,593,246	0.1
				<u>21,167,502</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Geely Finance Hong Kong Ltd.	3.00%	03/05/2025	6,400	41,355,059	0.8
Levc Finance Ltd.	1.38%	03/25/2024	6,000	38,229,320	0.7
Weichai International Hong Kong Energy Group Co., Ltd.(a)	3.75%	09/14/2022	2,947	19,036,853	0.3
				<u>98,621,232</u>	<u>1.8</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Minor International PCL(a)	3.10%	06/29/2023	242	1,558,926	0.0
Sands China Ltd.	5.13%	08/08/2025	650	4,621,084	0.1
				<u>6,180,010</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
Haidilao International Holding Ltd.	2.15%	01/14/2026	1,316	8,295,655	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	3.00%	01/13/2026	5,185	33,583,162	0.6
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Tingyi Cayman Islands Holding Corp.	1.63%	09/24/2025	2,015	12,756,666	0.2
ENERGIE					
Contemporary Ruiding Development Ltd.	2.63%	09/17/2030	2,720	17,042,520	0.3
COSL Singapore Capital Ltd.	2.50%	06/24/2030	2,229	13,383,764	0.2
COSL Singapore Capital Ltd.	4.50%	07/30/2025	500	3,486,382	0.1
Thaioil Treasury Center Co., Ltd.	5.38%	11/20/2048	465	3,403,222	0.1
				<u>37,315,888</u>	<u>0.7</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
CK Hutchison Capital Securities 17 Ltd.(a)	4.00%	05/12/2022	3,435	22,266,113	0.4
GLP China Holdings Ltd.	2.95%	03/29/2026	4,271	27,430,359	0.5
				<u>49,696,472</u>	<u>0.9</u>
Dienstleistungen					
Alibaba Group Holding Ltd.	2.70%	02/09/2041	5,885	34,816,499	0.6
Alibaba Group Holding Ltd.	3.40%	12/06/2027	1,159	8,061,865	0.1
JD.com, Inc.	3.38%	01/14/2030	2,155	14,394,130	0.3
JD.com, Inc.	3.88%	04/29/2026	750	5,242,996	0.1
JD.com, Inc.	4.13%	01/14/2050	500	3,283,634	0.1
				<u>65,799,124</u>	<u>1.2</u>
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	2.38%	10/09/2030	2,000	12,510,356	0.2
Baidu, Inc.	4.38%	03/29/2028	600	4,281,647	0.1
				<u>16,792,003</u>	<u>0.3</u>
TRANSPORTWESEN – Dienstleistungen					
CMB International Leasing Management Ltd.	2.00%	02/04/2026	1,700	10,741,549	0.2
CMB International Leasing Management Ltd.	2.88%	02/04/2031	2,285	14,125,052	0.3
HPHT Finance 19 Ltd.	2.88%	11/05/2024	1,245	8,342,096	0.2
HPHT Finance 21 Ltd.	2.00%	03/19/2026	1,000	6,466,016	0.1
Shanghai Port Group BVI Development 2 Co., Ltd.	2.38%	07/13/2030	3,400	21,266,753	0.4
Shanghai Port Group BVI Development Co., Ltd.	3.38%	06/18/2029	1,000	6,738,125	0.1
				<u>67,679,591</u>	<u>1.3</u>
				<u>540,148,100</u>	<u>10.0</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Adani Electricity Mumbai Ltd.	3.95%	02/12/2030	5,060	32,751,079	0.6
Adani Transmission Ltd.	4.00%	08/03/2026	500	3,401,013	0.1
Adani Transmission Ltd.	4.25%	05/21/2036	561	3,692,408	0.1
Castle Peak Power Finance Co., Ltd.	2.13%	03/03/2031	3,000	18,504,852	0.3
China Southern Power Grid International Finance BVI Co., Ltd.	3.50%	05/08/2027	940	6,552,530	0.1
CLP Power HK Finance Ltd.(a)	3.55%	02/06/2025	1,200	7,940,011	0.1
LLPL Capital Pte Ltd.	6.88%	02/04/2039	378	2,780,897	0.1
Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak.	4.85%	10/14/2038	1,544	10,857,645	0.2
				<u>86,480,435</u>	<u>1.6</u>

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
ERDGAS							
	Enn Clean Energy International	3.38%	05/12/2026	USD	2,900	¥ 18,657,818	0.4%
	ENN Energy Holdings Ltd.	2.63%	09/17/2030		4,206	26,194,372	0.5
	Perusahaan Gas Negara Tbk PT.	5.13%	05/16/2024		1,000	7,002,591	0.1
	Talent Yield International Ltd.	2.00%	05/06/2026		3,558	22,833,078	0.4
						<u>74,687,859</u>	<u>1.4</u>
						<u>161,168,294</u>	<u>3.0</u>
						<u>1,358,571,718</u>	<u>25.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN							
FINANZINSTITUTE							
BANKWESEN							
	Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	3.75%	03/30/2026		2,501	16,184,653	0.3
	Bank of East Asia Ltd. (The)(a)	5.88%	09/19/2024		1,602	10,839,074	0.2
	Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT	4.20%	01/23/2025		243	1,576,965	0.0
	Krung Thai Bank PCL/Cayman Islands(a)	4.40%	03/25/2026		3,740	23,946,731	0.5
	Nanyang Commercial Bank Ltd.(a)	5.00%	06/02/2022		1,018	6,546,461	0.1
	Rizal Commercial Banking Corp.(a)	6.50%	08/27/2025		1,500	9,817,866	0.2
	State Bank of India/Dubai(a)	5.50%	09/22/2021		600	3,842,437	0.1
	TMBThanachart Bank PCL(a)	4.90%	12/02/2024		1,895	12,180,916	0.2
	Woori Bank(a)	5.25%	05/16/2022		1,000	6,537,290	0.1
						<u>91,472,393</u>	<u>1.7</u>
FINANZEN							
	Central Huijin Investment Ltd.	3.50%	11/03/2023	CNY	10,000	10,041,257	0.2
	Central Huijin Investment Ltd.	3.45%	05/22/2022		10,000	10,049,893	0.2
						<u>20,091,150</u>	<u>0.4</u>
REITS							
	Central China Real Estate Ltd.	6.75%	11/08/2021	USD	400	2,532,463	0.0
	Central China Real Estate Ltd.	7.75%	05/24/2024		565	3,365,339	0.1
	Central China Real Estate Ltd.	7.90%	11/07/2023		3,200	19,711,529	0.4
	China Aoyuan Group Ltd.	6.20%	03/24/2026		3,950	23,553,004	0.4
	China SCE Group Holdings Ltd.	5.88%	03/10/2022		400	2,575,903	0.0
	China SCE Group Holdings Ltd.	6.00%	02/04/2026		500	3,118,591	0.1
	China SCE Group Holdings Ltd.	7.00%	05/02/2025		934	6,125,412	0.1
	China SCE Group Holdings Ltd.	7.25%	04/19/2023		600	3,963,675	0.1
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	5.25%	05/13/2026		800	5,252,088	0.1
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	5.95%	10/20/2025		800	5,398,625	0.1
	CIFI Holdings Group Co., Ltd.	6.70%	04/23/2022	CNH	5,000	5,103,148	0.1
	Easy Tactic Ltd.	8.13%	02/27/2023	USD	965	5,993,790	0.1
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	7.38%	10/04/2021		600	3,781,590	0.1
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	9.88%	10/19/2023		550	3,207,329	0.1
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	11.75%	04/17/2022		700	4,420,207	0.1
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	11.88%	06/01/2023		600	3,713,641	0.1
	Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	12.25%	10/18/2022		690	4,370,665	0.1
	Greentown China Holdings Ltd.	5.65%	07/13/2025		600	3,956,094	0.1
	Jababeka International BV	6.50%	10/05/2023		200	1,242,634	0.0
	Kaisa Group Holdings Ltd.	8.50%	06/30/2022		400	2,591,229	0.0
	Kaisa Group Holdings Ltd.	9.38%	06/30/2024		925	5,832,417	0.1
	Kaisa Group Holdings Ltd.	11.25%	04/09/2022		700	4,598,374	0.1
	Kaisa Group Holdings Ltd.	11.25%	04/16/2025		200	1,278,709	0.0
	Kaisa Group Holdings Ltd.	11.70%	11/11/2025		350	2,241,618	0.0
	KWG Group Holdings Ltd.	6.30%	02/13/2026		985	6,378,080	0.1
	KWG Group Holdings Ltd.	7.88%	08/09/2021		500	3,213,962	0.1
	LMIRT Capital Pte Ltd.	7.50%	02/09/2026		1,266	8,395,534	0.1
	Logan Group Co., Ltd.	4.25%	09/17/2024		615	3,908,932	0.1
	Logan Group Co., Ltd.	4.85%	12/14/2026		1,057	6,775,117	0.1
	Logan Group Co., Ltd.	6.90%	06/09/2024		400	2,681,781	0.0
	Logan Group Co., Ltd.	7.50%	08/27/2021		200	1,284,948	0.0
	Logan Group Co., Ltd.	7.50%	08/25/2022		400	2,601,977	0.0
	Modernland Overseas Pte Ltd.(b)	6.95%	04/13/2024		200	506,105	0.0
	New Metro Global Ltd.	4.80%	12/15/2024		1,516	9,711,573	0.2
	NWD MTN Ltd.	3.75%	01/14/2031		231	1,465,109	0.0
	NWD MTN Ltd.	4.13%	07/18/2029		1,400	9,193,964	0.2
	NWD MTN Ltd.	4.50%	05/19/2030		919	6,190,510	0.1
	Pakuwon Jati Tbk PT	4.88%	04/29/2028		1,010	6,587,399	0.1
	Redsun Properties Group Ltd.	9.95%	04/11/2022		2,195	14,458,112	0.3
	RKPF Overseas 2019 A Ltd.	5.90%	03/05/2025		1,100	7,271,949	0.1
	RKPF Overseas 2020 A Ltd.	5.20%	01/12/2026		905	5,787,398	0.1
	Ronshine China Holdings Ltd.	7.10%	01/25/2025		975	5,774,782	0.1
	Ronshine China Holdings Ltd.	7.35%	12/15/2023		200	1,239,723	0.0
	Ronshine China Holdings Ltd.	8.95%	01/22/2023		1,165	7,517,121	0.1
	Ronshine China Holdings Ltd.	10.50%	03/01/2022		900	5,862,085	0.1
	Scenery Journey Ltd.	11.50%	10/24/2022		1,695	10,170,684	0.2
	Seazen Group Ltd.	6.15%	04/15/2023		650	4,230,214	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
Seazen Group Ltd.	6.45%	06/11/2022	USD 700	¥ 4,554,414	0.1%
Sunac China Holdings Ltd.	5.95%	04/26/2024	3,996	25,848,744	0.5
Sunac China Holdings Ltd.	6.65%	08/03/2024	1,948	12,851,814	0.2
Sunac China Holdings Ltd.	8.35%	04/19/2023	900	5,976,440	0.1
Theta Capital Pte Ltd.	8.13%	01/22/2025	860	5,721,473	0.1
Times China Holdings Ltd.	6.75%	07/08/2025	1,560	10,270,180	0.2
Wanda Group Overseas Ltd.	7.50%	07/24/2022	1,401	8,487,354	0.2
Wanda Properties Overseas Ltd.	6.88%	07/23/2023	2,260	14,167,593	0.3
Wheelock & Co., Ltd.	2.38%	01/25/2026	4,830	30,749,140	0.6
Yango Justice International Ltd.	7.50%	04/15/2024	1,220	7,800,826	0.1
Yango Justice International Ltd.	7.88%	09/04/2024	3,111	19,566,717	0.4
Yango Justice International Ltd.	8.25%	11/25/2023	700	4,514,858	0.1
Yango Justice International Ltd.	9.25%	04/15/2023	459	3,003,354	0.1
Yanlord Land HK Co., Ltd.	5.13%	05/20/2026	1,640	10,608,322	0.2
Yanlord Land HK Co., Ltd.	6.80%	02/27/2024	935	6,246,230	0.1
Yuzhou Group Holdings Co Ltd.	6.00%	10/25/2023	1,710	10,219,642	0.2
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	7.70%	02/20/2025	4,085	23,916,514	0.4
Zhenro Properties Group Ltd.	6.63%	01/07/2026	683	4,142,211	0.1
Zhenro Properties Group Ltd.	8.30%	09/15/2023	500	3,289,530	0.1
Zhenro Properties Group Ltd.	8.35%	03/10/2024	755	4,976,316	0.1
Zhenro Properties Group Ltd.	9.80%	08/20/2021	200	1,284,789	0.0
Zhongliang Holdings Group Co., Ltd.	9.50%	07/29/2022	2,025	12,704,764	0.2
Zhongliang Holdings Group Co., Ltd.	11.50%	09/26/2021	1,595	10,209,733	0.2
				<u>500,246,091</u>	<u>9.2</u>
				<u>611,809,634</u>	<u>11.3</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ABJA Investment Co. Pte Ltd.	5.45%	01/24/2028	1,580	10,671,799	0.2
China Hongqiao Group Ltd.	7.13%	07/22/2022	903	5,893,588	0.1
China Hongqiao Group Ltd.	7.38%	05/02/2023	500	3,301,555	0.1
China Shenhua Overseas Capital Co., Ltd.	3.88%	01/20/2025	850	5,647,967	0.1
Periama Holdings LLC/DE	5.95%	04/19/2026	1,380	9,463,206	0.2
Shandong Iron & Steel Group Co., Ltd.	4.98%	09/27/2022	CNY 10,000	9,829,109	0.2
Shandong Iron and Steel Xinheng International Co., Ltd.	6.50%	11/05/2023	USD 2,630	16,994,345	0.3
Shandong Iron and Steel Xinheng International Co., Ltd.	6.85%	09/25/2022	1,882	12,160,972	0.2
Yingde Gases Investment Ltd.	6.25%	01/19/2023	2,835	18,555,766	0.3
				<u>92,518,307</u>	<u>1.7</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
CAS Capital No. 1 Ltd.(a)	4.00%	07/12/2026	2,358	14,989,185	0.2
Network i2i Ltd.(a)	5.65%	01/15/2025	500	3,375,028	0.1
SmarTone Finance Ltd.	3.88%	04/08/2023	720	4,749,800	0.1
				<u>23,114,013</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
TML Holdings Pte Ltd.	5.50%	06/03/2024	1,915	12,642,287	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Champion Path Holdings Ltd.	4.85%	01/27/2028	1,085	7,239,669	0.1
Fortune Star BVI Ltd.	5.05%	01/27/2027	1,985	12,719,958	0.2
Fortune Star BVI Ltd.	5.95%	10/19/2025	1,520	10,169,411	0.2
Fortune Star BVI Ltd.	6.85%	07/02/2024	945	6,419,016	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	1,820	12,304,645	0.2
Melco Resorts Finance Ltd.	5.75%	07/21/2028	460	3,121,398	0.1
MGM China Holdings Ltd.	4.75%	02/01/2027	3,900	25,576,353	0.5
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	2,076	13,749,668	0.3
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	200	1,337,285	0.0
Modern Land China Co., Ltd.	9.80%	04/11/2023	1,344	8,132,078	0.2
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	1,042	6,739,337	0.1
Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	1,553	10,623,036	0.2
Wynn Macau Ltd.	5.13%	12/15/2029	338	2,218,610	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	960	6,401,941	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	940	6,259,293	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	714	4,776,728	0.1
				<u>137,788,426</u>	<u>2.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
Jollibee Worldwide Pte Ltd.(a)	3.90%	01/23/2025	1,285	8,070,799	0.2
Jollibee Worldwide Pte Ltd.	4.75%	06/24/2030	400	2,656,594	0.0
				<u>10,727,393</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Baoxin Auto Finance I Ltd.(a)	9.11%	10/30/2021	400	1,890,915	0.0
China Grand Automotive Services Ltd.	8.63%	04/08/2022	840	5,157,261	0.1
SM Investments Corp.	4.88%	06/10/2024	1,500	10,282,928	0.2
				<u>17,331,104</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Japfa Comfeed Indonesia Tbk PT	5.38%	03/23/2026	USD 984	¥ 6,563,789	0.1%
ENERGIE					
Adani Green Energy UP Ltd./Prayatna Developers Pvt Ltd./					
Parampujya Solar Energ	6.25%	12/10/2024	770	5,428,008	0.1
Anton Oilfield Services Group/Hong Kong	7.50%	12/02/2022	570	3,530,172	0.1
Greenko Dutch BV	3.85%	03/29/2026	1,669	10,856,346	0.1
Greenko Solar Mauritius Ltd.	5.95%	07/29/2026	600	4,096,564	0.1
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	439	2,891,694	0.1
Medco Bell Pte Ltd.	6.38%	01/30/2027	472	3,086,539	0.1
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	400	2,777,970	0.0
ReNew Power Pvt Ltd.	6.45%	09/27/2022	1,090	7,173,329	0.1
				<u>39,840,622</u>	<u>0.7</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Li & Fung Ltd.(a)	5.25%	11/03/2021	500	2,298,670	0.1
TECHNOLOGIE					
Lenovo Group Ltd.	5.88%	04/24/2025	1,100	7,952,205	0.2
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Royal Capital BV(a)	5.88%	05/05/2022	1,200	7,878,154	0.2
				<u>358,654,970</u>	<u>6.7</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Clean Renewable Power Mauritius Pte Ltd.	4.25%	03/25/2027	1,798	11,525,230	0.2
Jsw Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	3,161	20,296,040	0.4
ReNew Wind Energy AP2/ReNew Power Pvt Ltd. other					
9 Subsidiaries	4.50%	07/14/2028	1,604	10,155,380	0.2
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	355	2,566,196	0.0
				<u>44,542,846</u>	<u>0.8</u>
				<u>1,015,007,450</u>	<u>18.8</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
CHINA					
Agricultural Development Bank of China, Series 2008	3.45%	09/23/2025	CNY 140,000	140,889,251	2.6
Agricultural Development Bank of China, Series 2010	3.79%	10/26/2030	70,000	71,374,056	1.3
China Development Bank, Series 2102	2.98%	01/08/2024	94,000	93,803,845	1.8
				<u>306,067,152</u>	<u>5.7</u>
SÜDKOREA					
Industrial Bank of Korea(a)	3.90%	07/31/2022	USD 729	4,742,491	0.1
VIETNAM					
Viet Nam Debt & Asset Trading Corp.	1.00%	10/10/2025	1,300	7,363,657	0.1
				<u>318,173,300</u>	<u>5.9</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
CHINA					
China Government Bond, Series 1906	3.29%	05/23/2029	CNY 20,000	20,274,620	0.4
China Government Bond, Series INBK	3.28%	12/03/2027	35,000	35,460,219	0.7
China Government Bond, Series INBK	3.39%	03/16/2050	50,000	47,555,243	0.9
China Government Bond, Series INBK	3.81%	09/14/2050	60,000	61,886,733	1.1
				<u>165,176,815</u>	<u>3.1</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - China Bond Portfolio - Class SA			985,799	100,945,844	1.9
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	8.25%	09/30/2025	USD 350	2,468,306	0.0
Gesamtanlagen					
(Kosten ¥5,092,906,375)				¥ 4,990,007,471	92.3%
Termineinlagen					
Sumitomo, Tokyo(c)	0.01 %	—		28,781,351	0.6
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					
				385,699,527	7.1
Nettovermögen				<u>¥ 5,404,488,349</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2021	124	¥ 114,112,703	¥ 114,371,552	¥ (258,849)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	70	98,271,865	98,318,843	(46,978)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	217	170,722,171	171,013,333	(291,162)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	567	476,076,900	476,014,362	62,538
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2021	10	11,822,938	11,787,643	35,295
					¥ (499,156)
				Wertsteigerung	¥ 97,833
				Wertminderung	¥ (596,989)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
HSBC Bank USA	USD 249,267	CNH 1,626,243	06/24/2021	¥ 37,854,542
HSBC Bank USA	USD 200,000	CNH 1,322,360	09/15/2021	40,982,263
Societe Generale	CNH 20,528	USD 3,127	06/24/2021	(600,700)
Standard Chartered Bank	KRW 4,443	USD 4	07/22/2021	11
				¥ 78,236,116
			Wertsteigerung	¥ 78,836,816
			Wertminderung	¥ (600,700)

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nomineller Betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Kaufkontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	People's Republic of China	06/20/2026	USD 80,000	¥ (15,912,107)	¥ (600,163)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominalbetrag (000)	Abschlussdatum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 8,124	11/09/2025	2.108%	3 Month LIBOR	¥ (3,051,804)
Swaps insgesamt					¥ (3,651,967)

- (a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (b) Not leidend.
- (c) Tagesgeld.

Währungskürzel:

CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY – Chinese Yuan Renminbi
KRW – South Korean Won
USD – United States Dollar

Glossar:

CBT – Chicago Board of Trade
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
LCH – London Clearing House
LIBOR – London Interbank Offered Rate
MTN – Medium Term Note

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ArcelorMittal SA	3.60%	07/16/2024	USD 2,000	\$ 2,133,246	0.2%
ArcelorMittal SA	4.55%	03/11/2026	1,000	1,114,927	0.1
Arconic Corp.....	6.00%	05/15/2025	1,311	1,399,350	0.1
Ashland LLC	4.75%	08/15/2022	496	514,682	0.0
Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV	4.75%	06/15/2027	2,192	2,279,680	0.2
Berry Global, Inc.	5.13%	07/15/2023	688	692,693	0.1
CF Industries, Inc.	3.45%	06/01/2023	5,272	5,484,981	0.4
Cleveland-Cliffs, Inc.....	6.75%	03/15/2026	114	123,151	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.....	9.88%	10/17/2025	5,081	5,947,611	0.4
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	5.13%	05/15/2024	2,232	2,431,462	0.2
Freeport-McMoRan, Inc.....	3.88%	03/15/2023	2,911	3,030,390	0.2
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027	3,000	3,227,139	0.2
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.....	7.38%	12/15/2023	2,006	2,048,439	0.1
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	EUR 102	126,977	0.0
INEOS Quattro Finance 2 PLC	2.50%	01/15/2026	1,615	1,977,328	0.1
INEOS Quattro Finance 2 PLC	3.38%	01/15/2026	USD 3,562	3,563,908	0.3
Kraton Polymers LLC/Kraton Polymers Capital Corp.....	4.25%	12/15/2025	3,399	3,448,628	0.3
NOVA Chemicals Corp.....	4.88%	06/01/2024	3,700	3,886,718	0.3
OCI NV	5.25%	11/01/2024	4,287	4,423,529	0.3
Olin Corp.	5.13%	09/15/2027	1,535	1,602,217	0.1
Peabody Energy Corp.(a)	8.50%	12/31/2024	2,040	1,289,976	0.1
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.....	10.00%	12/31/2024	2,301	2,226,217	0.2
Reynolds Group Issuer, Inc./Reynolds Group Issuer LLC/ Reynolds Group Issuer Lu.....	4.00%	10/15/2027	7,250	7,120,943	0.5
Sealed Air Corp.....	5.50%	09/15/2025	5,731	6,361,476	0.5
SPCM SA	4.88%	09/15/2025	3,465	3,550,186	0.3
thyssenkrupp AG	2.88%	02/22/2024	EUR 950	1,180,770	0.1
WR Grace & Co.-Conn	4.88%	06/15/2027	USD 6,951	7,321,790	0.5
				<u>78,508,414</u>	<u>5.8</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	4.13%	08/15/2026	4,543	4,652,500	0.3
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	08/15/2027	3,000	3,029,100	0.2
Ball Corp.....	4.88%	03/15/2026	2,000	2,228,445	0.2
Ball Corp.....	5.00%	03/15/2022	1,052	1,086,292	0.1
Bombardier, Inc.	6.00%	10/15/2022	42	42,048	0.0
Bombardier, Inc.	6.13%	01/15/2023	2,810	2,951,093	0.2
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025	40	40,317	0.0
Clean Harbors, Inc.	4.88%	07/15/2027	5,526	5,808,090	0.4
Crown European Holdings SA.....	2.25%	02/01/2023	EUR 1,175	1,466,683	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026	USD 3,647	3,829,350	0.3
GFL Environmental, Inc.....	3.75%	08/01/2025	5,715	5,848,857	0.4
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	2,308	2,350,266	0.2
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	2,000	2,059,399	0.2
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	EUR 875	1,107,425	0.1
Rolls-Royce PLC	2.13%	06/18/2021	3,494	4,262,448	0.3
Rolls-Royce PLC	3.63%	10/14/2025	USD 2,000	2,009,814	0.2
Signature Aviation US Holdings, Inc.	5.38%	05/01/2026	4,095	4,204,772	0.3
Silgan Holdings, Inc.....	2.25%	06/01/2028	EUR 1,352	1,655,720	0.1
Silgan Holdings, Inc.....	4.13%	02/01/2028	USD 2,000	2,067,236	0.2
SPX FLOW, Inc.	5.88%	08/15/2026	2,453	2,539,609	0.2
Tervita Corp.	11.00%	12/01/2025	2,114	2,375,315	0.2
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	2,350	2,395,785	0.2
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	2,898	3,207,929	0.2
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	EUR 343	425,909	0.0
Trivium Packaging Finance BV.....	5.50%	08/15/2026	USD 558	583,342	0.0
Vertical US Newco, Inc.....	5.25%	07/15/2027	2,478	2,577,845	0.2
Wesco Distribution, Inc.....	7.13%	06/15/2025	4,009	4,331,005	0.3
				<u>69,136,594</u>	<u>5.1</u>
KOMMUNIKATIONS MEDIEN					
Altice Financing SA.....	2.25%	01/15/2025	EUR 546	651,156	0.0
Altice Financing SA.....	5.00%	01/15/2028	USD 4,155	4,120,814	0.3
AMC Networks, Inc.	5.00%	04/01/2024	718	728,152	0.1
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	5,274	5,397,954	0.4
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.00%	03/01/2023	4,720	4,769,361	0.4
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.13%	05/01/2027	3,153	3,303,711	0.2
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.50%	05/01/2026	1,456	1,504,920	0.1
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	5,335	5,382,578	0.4
CSC Holdings LLC	5.25%	06/01/2024	1,817	1,968,969	0.1
CSC Holdings LLC	5.50%	04/15/2027	4,000	4,200,056	0.3
CSC Holdings LLC	5.88%	09/15/2022	990	1,039,498	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
CSC Holdings LLC	6.75%	11/15/2021	USD 1,701	\$ 1,741,730	0.1%
DISH DBS Corp.	5.00%	03/15/2023	976	1,015,224	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	07/15/2022	307	319,300	0.0
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	2,816	2,997,915	0.2
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026	1,139	1,293,636	0.1
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	522	540,050	0.0
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	4,410	4,708,336	0.4
Lamar Media Corp.	3.75%	02/15/2028	1,850	1,866,873	0.1
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	5,544	5,932,755	0.4
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026	3,515	3,672,561	0.3
Netflix, Inc.	3.63%	05/15/2027	EUR 4,121	5,767,119	0.4
Netflix, Inc.	4.88%	04/15/2028	USD 1,750	2,011,400	0.2
Sinclair Television Group, Inc.	5.13%	02/15/2027	2,140	2,141,956	0.2
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	08/01/2022	3,629	3,644,951	0.3
Sirius XM Radio, Inc.	4.63%	07/15/2024	488	500,356	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.00%	08/01/2027	624	653,068	0.1
TEGNA, Inc.	4.75%	03/15/2026	3,465	3,688,545	0.3
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025	265	269,638	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	3,148	3,411,407	0.3
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025	435	480,273	0.0
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	2,229	2,359,669	0.2
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	08/15/2026	5,662	5,874,784	0.4
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027	4,667	4,853,181	0.4
				<u>92,811,896</u>	<u>6.9</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026	2,012	2,092,367	0.2
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	2,000	2,180,416	0.2
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	4,397	4,561,624	0.3
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	942	960,377	0.1
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	2,608	2,819,440	0.2
Frontier Communications Holdings LLC	5.88%	10/15/2027	1,563	1,660,627	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	5.25%	08/01/2026	987	1,098,130	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	3,000	3,331,740	0.2
Hughes Satellite Systems Corp.	7.63%	06/15/2021	860	861,460	0.1
Level 3 Financing, Inc.	4.63%	09/15/2027	2,000	2,058,360	0.1
Lumen Technologies, Inc., Series T	5.80%	03/15/2022	2,161	2,229,338	0.2
Lumen Technologies, Inc., Series Y	7.50%	04/01/2024	2,000	2,239,566	0.2
Lumen Technologies, Inc.	5.13%	12/15/2026	2,000	2,073,330	0.2
Lumen Technologies, Inc., Series S	6.45%	06/15/2021	4,443	4,450,993	0.3
Sprint Communications, Inc.	6.00%	11/15/2022	572	607,862	0.0
Sprint Corp.	7.25%	09/15/2021	995	1,012,128	0.1
Sprint Corp.	7.88%	09/15/2023	299	338,459	0.0
T-Mobile USA, Inc.	2.25%	02/15/2026	2,645	2,666,180	0.2
T-Mobile USA, Inc.	2.63%	04/15/2026	3,614	3,679,046	0.3
T-Mobile USA, Inc.	4.00%	04/15/2022	1,979	2,023,789	0.1
Telecom Italia SpA/Milano	5.30%	05/30/2024	490	532,587	0.0
Telecom Italia SpA/Milano	5.88%	05/19/2023	700	1,078,566	0.1
Zayo Group Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2027	USD 1,032	1,013,853	0.1
				<u>45,570,238</u>	<u>3.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025	1,430	1,580,075	0.1
Allison Transmission, Inc.	4.75%	10/01/2027	1,010	1,057,901	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	04/01/2025	2,711	2,803,166	0.2
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	385	408,839	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	EUR 2,536	3,205,138	0.2
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	USD 2,459	2,625,696	0.2
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023	2,365	2,640,704	0.2
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025	403	492,347	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.09%	01/09/2023	400	407,609	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.10%	05/04/2023	400	408,055	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	3.22%	01/09/2022	869	878,170	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	4.06%	11/01/2024	495	522,948	0.0
Ford Motor Credit Co. LLC	4.14%	02/15/2023	1,200	1,245,880	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	2,071	2,114,002	0.2
IHO Verwaltungs GmbH(a)	3.63%	05/15/2025	EUR 915	1,137,547	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	4.75%	09/15/2026	USD 2,000	2,053,977	0.2
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.00%	05/15/2027	1,240	1,306,694	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	2.20%	01/15/2024	EUR 132	158,750	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	130	172,373	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	USD 698	710,947	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	6.88%	11/15/2026	EUR 2,567	3,577,098	0.3
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	USD 1,465	1,595,673	0.1
Meritor, Inc.	6.25%	02/15/2024	1,374	1,388,317	0.1
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	234	248,978	0.0
Tenneco, Inc.	7.88%	01/15/2029	1,207	1,352,843	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ZF Finance GmbH	3.00%	09/21/2025	EUR 2,000	\$ 2,570,422	0.2%
ZF North America Capital, Inc.	4.50%	04/29/2022	USD 3,475	3,575,097	0.3
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	1,700	1,844,488	0.1
				<u>42,083,734</u>	<u>3.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Boyne USA, Inc.	4.75%	05/15/2029	1,347	1,388,046	0.1
Carnival Corp.	1.88%	11/07/2022	EUR 3,465	4,178,762	0.3
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	USD 1,744	1,853,000	0.1
Carnival Corp.	10.13%	02/01/2026	EUR 633	900,284	0.1
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023	USD 2,768	3,165,293	0.2
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.38%	04/15/2027	1,010	1,035,894	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.50%	05/01/2025	4,942	5,162,641	0.4
Mattel, Inc.	3.38%	04/01/2026	5,915	6,130,887	0.5
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	2,000	2,190,829	0.2
NCL Corp., Ltd.	3.63%	12/15/2024	6,921	6,619,417	0.5
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	2,669	2,805,786	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	1,445	1,658,138	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	2,603	3,012,973	0.2
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025	932	1,008,443	0.1
Silversea Cruise Finance Ltd.	7.25%	02/01/2025	1,005	1,040,112	0.1
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	4,298	4,631,808	0.3
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	912	972,254	0.1
Viking Cruises Ltd.	13.00%	05/15/2025	2,387	2,795,092	0.2
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5.63%	02/15/2029	836	847,222	0.1
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	2,000	2,015,006	0.1
				<u>53,411,887</u>	<u>4.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	2,176	2,289,813	0.2
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	5,800	6,120,282	0.4
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	5,493	5,792,072	0.4
Churchill Downs, Inc.	5.50%	04/01/2027	5,009	5,209,367	0.4
Empire Communities Corp.	7.00%	12/15/2025	3,716	3,941,403	0.3
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025	4,400	4,650,658	0.3
Forestar Group, Inc.	3.85%	05/15/2026	2,578	2,589,667	0.2
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp.	6.50%	07/15/2025	2,232	2,405,486	0.2
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025	2,688	2,827,461	0.2
Hilton Grand Vacations Borrower LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower, Inc.	6.13%	12/01/2024	2,800	2,947,173	0.2
International Game Technology PLC	4.13%	04/15/2026	3,439	3,552,443	0.3
International Game Technology PLC	6.50%	02/15/2025	275	305,497	0.0
KB Home	7.00%	12/15/2021	496	505,163	0.0
KB Home	7.50%	09/15/2022	1,059	1,141,073	0.1
KB Home	7.63%	05/15/2023	840	914,424	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	723	768,846	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC	6.50%	09/15/2026	5,318	5,540,453	0.4
Mattamy Group Corp.	5.25%	12/15/2027	870	906,720	0.1
MGM Resorts International	6.00%	03/15/2023	1,207	1,289,981	0.1
MGM Resorts International	7.75%	03/15/2022	865	907,240	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	9.13%	06/15/2023	2,000	2,210,000	0.2
Samsonite Finco SARL	3.50%	05/15/2026	EUR 272	323,075	0.0
Scientific Games International, Inc.	5.00%	10/15/2025	USD 4,987	5,138,019	0.4
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	2,155	2,158,373	0.1
Standard Industries, Inc./NJ	5.00%	02/15/2027	5,000	5,177,178	0.4
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	2,011	2,258,773	0.2
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.88%	04/15/2023	235	249,100	0.0
Toll Brothers Finance Corp.	4.38%	04/15/2023	5,176	5,431,495	0.4
Travel + Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	155	177,452	0.0
Wyndham Destinations, Inc.	3.90%	03/01/2023	4,000	4,138,033	0.3
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.75%	04/15/2025	3,000	3,233,157	0.2
				<u>85,099,877</u>	<u>6.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	3.88%	01/15/2028	1,894	1,901,254	0.1
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	4.38%	01/15/2028	2,000	2,024,751	0.2
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	5.75%	04/15/2025	3,112	3,297,583	0.3
IRB Holding Corp.	7.00%	06/15/2025	1,761	1,901,834	0.1
KFC Holding Co./Pizza Hut Holdings LLC/ Taco Bell of America LLC	4.75%	06/01/2027	1,159	1,214,113	0.1
KFC Holding Co./Pizza Hut Holdings LLC/ Taco Bell of America LLC	5.25%	06/01/2026	1,886	1,935,508	0.1
Yum! Brands, Inc.	7.75%	04/01/2025	1,408	1,531,468	0.1
				<u>13,806,511</u>	<u>1.0</u>

AB SICAV I
Short Duration High Yield Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Burlington Coat Factory Warehouse Corp.	6.25%	04/15/2025	USD 900	\$ 971,187	0.1%
Dufry One BV	2.50%	10/15/2024	EUR 2,375	2,862,071	0.2
Hanesbrands, Inc.	4.63%	05/15/2024	USD 5,155	5,467,618	0.4
Hanesbrands, Inc.	4.88%	05/15/2026	988	1,057,487	0.1
L Brands, Inc.	5.25%	02/01/2028	3,250	3,531,948	0.2
Levi Strauss & Co.	5.00%	05/01/2025	972	992,004	0.1
Magic Mergeco, Inc.	5.25%	05/01/2028	4,950	5,007,399	0.3
Penske Automotive Group, Inc.	3.50%	09/01/2025	4,155	4,278,406	0.3
Penske Automotive Group, Inc.	5.50%	05/15/2026	723	744,214	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	941	974,720	0.1
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	3,595	3,748,154	0.3
SRS Distribution, Inc.	4.63%	07/01/2028	3,832	3,868,066	0.3
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	3,626	3,761,838	0.3
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024	641	704,637	0.1
William Carter Co. (The)	5.50%	05/15/2025	533	562,422	0.0
William Carter Co. (The)	5.63%	03/15/2027	4,715	4,939,589	0.3
				<u>43,471,760</u>	<u>3.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	3.25%	03/15/2026	913	917,450	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	3.50%	02/15/2023	3,469	3,558,334	0.3
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	4.63%	01/15/2027	2,428	2,513,257	0.2
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	5.75%	03/15/2025	203	208,469	0.0
Avantor Funding, Inc.	2.63%	11/01/2025	EUR 2,333	2,919,803	0.2
Catalent Pharma Solutions, Inc.	5.00%	07/15/2027	USD 4,000	4,162,109	0.3
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	1,652	1,763,502	0.1
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	EUR 497	609,972	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.63%	02/15/2025	USD 1,290	1,356,951	0.1
Cidron Aida Finco SARL	5.00%	04/01/2028	EUR 393	485,165	0.0
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	USD 3,447	3,384,664	0.3
Global Medical Response, Inc.	6.50%	10/01/2025	1,025	1,055,158	0.1
HCA, Inc.	5.88%	02/15/2026	2,278	2,604,254	0.2
IQVIA, Inc.	1.75%	03/15/2026	EUR 2,202	2,708,360	0.2
IQVIA, Inc.	5.00%	10/15/2026	USD 4,139	4,294,982	0.3
Kraft Heinz Foods Co.	3.88%	05/15/2027	2,000	2,190,574	0.2
Kraft Heinz Foods Co.	4.63%	01/30/2029	3,393	3,837,517	0.3
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	5.00%	12/31/2026	2,856	2,904,423	0.2
Lamb Weston Holdings, Inc.	4.63%	11/01/2024	2,000	2,070,299	0.2
Lamb Weston Holdings, Inc.	4.88%	11/01/2026	2,000	2,070,127	0.2
Legacy LifePoint Health LLC	4.38%	02/15/2027	5,930	5,915,053	0.4
Legacy LifePoint Health LLC	6.75%	04/15/2025	610	646,958	0.1
MEDNAX, Inc.	6.25%	01/15/2027	3,734	3,960,742	0.3
ModivCare, Inc.	5.88%	11/15/2025	3,091	3,261,680	0.2
Newell Brands, Inc.	4.70%	04/01/2026	3,811	4,283,131	0.3
Newell Brands, Inc.	4.88%	06/01/2025	418	464,813	0.0
Organon Finance 1 LLC	4.13%	04/30/2028	2,728	2,753,012	0.2
Par Pharmaceutical, Inc.	7.50%	04/01/2027	2,671	2,725,646	0.2
Post Holdings, Inc.	5.75%	03/01/2027	5,926	6,207,365	0.5
RP Escrow Issuer LLC	5.25%	12/15/2025	2,631	2,723,113	0.2
Spectrum Brands, Inc.	5.75%	07/15/2025	175	179,428	0.0
Syneos Health, Inc.	3.63%	01/15/2029	2,401	2,349,236	0.2
Tenet Healthcare Corp.	4.63%	09/01/2024	605	620,095	0.0
Tenet Healthcare Corp.	4.88%	01/01/2026	4,432	4,576,624	0.3
Tenet Healthcare Corp.	5.13%	05/01/2025	3,470	3,518,718	0.3
US Acute Care Solutions LLC	6.38%	03/01/2026	1,126	1,165,302	0.1
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	1,524	1,587,503	0.1
				<u>92,553,789</u>	<u>6.9</u>
ENERGIE					
Antero Resources Corp.	8.38%	07/15/2026	345	389,170	0.0
Apache Corp.	4.63%	11/15/2025	466	494,795	0.0
Apache Corp.	4.88%	11/15/2027	429	450,403	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	3,925	4,245,339	0.3
Callon Petroleum, Co.	6.25%	04/15/2023	1,390	1,316,509	0.1
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	1,774	1,824,690	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	1,749	1,818,295	0.1
CNX Resources Corp.	7.25%	03/14/2027	2,000	2,149,196	0.2
Comstock Resources, Inc.	7.50%	05/15/2025	118	122,366	0.0
Continental Resources, Inc./OK	3.80%	06/01/2024	3,363	3,530,770	0.3
DCP Midstream Operating LP	4.95%	04/01/2022	4,441	4,538,242	0.3
EnLink Midstream LLC	5.63%	01/15/2028	815	848,465	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.15%	06/01/2025	2,035	2,079,093	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024	USD 1,579	\$ 1,638,603	0.1%
EnLink Midstream Partners LP	4.85%	07/15/2026	3,721	3,777,424	0.3
EQM Midstream Partners LP	4.75%	07/15/2023	632	660,080	0.1
EQM Midstream Partners LP	5.50%	07/15/2028	964	1,028,699	0.1
EQM Midstream Partners LP	6.00%	07/01/2025	3,000	3,248,437	0.2
EQT Corp.	3.00%	10/01/2022	70	71,497	0.0
EQT Corp.	7.63%	02/01/2025	456	532,413	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024	543	543,622	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	1,646	1,654,803	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	3,415	3,525,699	0.3
Hess Midstream Operations LP	5.63%	02/15/2026	962	999,989	0.1
Independence Energy Finance LLC	7.25%	05/01/2026	4,554	4,616,016	0.3
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	2,310	2,055,362	0.2
Nabors Industries, Inc.	5.75%	02/01/2025	750	622,189	0.0
Neptune Energy Bondco PLC	6.63%	05/15/2025	287	293,246	0.0
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	4,940	5,016,372	0.4
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	1,474	1,532,854	0.1
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023	2,067	2,013,610	0.2
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023	1,097	1,104,246	0.1
Occidental Petroleum Corp.	2.90%	08/15/2024	2,702	2,698,949	0.2
Occidental Petroleum Corp.	3.20%	08/15/2026	232	224,315	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.50%	12/01/2025	1,285	1,383,882	0.1
Occidental Petroleum Corp.	5.55%	03/15/2026	732	783,283	0.1
Ovintiv Exploration, Inc.	5.75%	01/30/2022	2,078	2,144,756	0.2
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	9.25%	05/15/2025	3,190	3,282,439	0.2
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	1,126	1,173,422	0.1
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023	908	935,971	0.1
Renewable Energy Group, Inc.	5.88%	06/01/2028	1,532	1,593,786	0.1
SM Energy Co.	6.13%	11/15/2022	2,315	2,304,998	0.2
Transocean Phoenix 2 Ltd.	7.75%	10/15/2024	1,307	1,323,197	0.1
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	1,040	1,015,348	0.1
Transocean Sentry Ltd.	5.38%	05/15/2023	1,265	1,213,327	0.1
Weatherford International Ltd.	11.00%	12/01/2024	393	397,004	0.0
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022	495	506,282	0.0
Western Midstream Operating LP	4.35%	02/01/2025	5,709	5,974,773	0.4
				<u>85,698,226</u>	<u>6.3</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
American Builders & Contractors Supply Co., Inc.	4.00%	01/15/2028	3,000	3,065,923	0.2
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	4,760	5,027,483	0.4
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025	6,004	6,133,048	0.4
Laureate Education, Inc.	8.25%	05/01/2025	683	711,174	0.1
Travis Perkins PLC	4.50%	09/07/2023	GBP 2,000	3,022,379	0.2
Univar Solutions USA, Inc./Washington	5.13%	12/01/2027	USD 2,000	2,097,978	0.2
				<u>20,057,985</u>	<u>1.5</u>
Dienstleistungen					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	5,644	5,992,770	0.4
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./					
Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	930	927,691	0.0
ANGI Group LLC	3.88%	08/15/2028	2,215	2,174,016	0.2
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	2,100	2,223,875	0.2
APX Group, Inc.	7.88%	12/01/2022	3,484	3,499,961	0.3
Aramark Services, Inc.	4.75%	06/01/2026	2,480	2,538,900	0.2
Aramark Services, Inc.	5.00%	04/01/2025	3,298	3,380,487	0.2
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023	EUR 984	1,193,371	0.1
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	USD 5,424	5,439,811	0.4
Intertrust Group BV	3.38%	11/15/2025	EUR 2,861	3,565,952	0.3
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028	USD 2,521	2,557,768	0.2
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	3.38%	08/31/2027	1,000	960,534	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	4,337	4,619,222	0.3
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	720	786,889	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	500	516,662	0.0
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025	406	418,208	0.0
Sabre GBLB, Inc.	7.38%	09/01/2025	1,440	1,553,121	0.1
Sabre GBLB, Inc.	9.25%	04/15/2025	2,252	2,636,455	0.2
Square, Inc.	2.75%	06/01/2026	6,522	6,574,186	0.5
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	3,655	3,937,896	0.3
Verisure Holding AB	3.25%	02/15/2027	EUR 3,316	4,076,160	0.3
				<u>59,573,935</u>	<u>4.4</u>
Technologie					
Avaya, Inc.	6.13%	09/15/2028	USD 1,719	1,823,560	0.1
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	5,132	5,499,532	0.4
CDK Global, Inc.	4.88%	06/01/2027	2,000	2,109,356	0.2
CDK Global, Inc.	5.00%	10/15/2024	2,375	2,616,040	0.2
CDW LLC/CDW Finance Corp.	4.13%	05/01/2025	5,018	5,245,334	0.4
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024	3,416	3,519,614	0.3

AB SICAV I
Short Duration High Yield Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Dell International LLC/EMC Corp.....	7.13%	06/15/2024	USD 2,521	\$ 2,575,400	0.2%
Imola Merger Corp.....	4.75%	05/15/2029	1,911	1,930,457	0.1
Ingram Micro, Inc.....	5.45%	12/15/2024	450	515,381	0.0
Microchip Technology, Inc.....	4.25%	09/01/2025	7,073	7,423,382	0.5
NCR Corp.....	5.75%	09/01/2027	3,099	3,262,965	0.2
NCR Corp.....	8.13%	04/15/2025	709	772,498	0.1
Nokia Oyj.....	3.38%	06/12/2022	2,805	2,881,434	0.2
Pitney Bowes, Inc.....	6.88%	03/15/2027	1,183	1,227,264	0.1
Presidio Holdings, Inc.....	4.88%	02/01/2027	3,057	3,140,911	0.2
Rackspace Technology Global, Inc.....	3.50%	02/15/2028	7,244	6,972,783	0.5
Seagate HDD Cayman.....	4.88%	03/01/2024	1,458	1,571,141	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.....	7.50%	09/01/2025	6,643	6,878,353	0.5
Western Digital Corp.....	4.75%	02/15/2026	5,714	6,347,058	0.5
Xerox Corp.....	4.07%	03/17/2022	2,049	2,086,843	0.2
Xerox Corp.....	4.38%	03/15/2023	1,992	2,072,593	0.2
				<u>70,471,899</u>	<u>5.2</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.....	5.50%	04/20/2026	2,713	2,865,695	0.2
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.....	5.75%	01/20/2026	3,868	4,109,750	0.3
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.....	8.00%	09/20/2025	3,478	3,944,262	0.3
United Airlines, Inc.....	4.38%	04/15/2026	4,842	5,018,964	0.4
				<u>15,938,671</u>	<u>1.2</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.....	5.75%	07/15/2027	254	267,503	0.0
Heathrow Finance PLC.....	5.25%	03/01/2024	GBP 2,000	2,990,400	0.2
Loxam SAS.....	3.50%	04/15/2022	EUR 389	474,568	0.1
Modulaire Global Finance PLC.....	6.50%	02/15/2023	497	616,043	0.1
Modulaire Global Finance PLC.....	8.00%	02/15/2023	USD 2,921	2,976,597	0.2
XPO Logistics, Inc.....	6.75%	08/15/2024	385	402,596	0.0
				<u>7,727,707</u>	<u>0.6</u>
				<u>875,923,123</u>	<u>64.9</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Alliance Data Systems Corp.....	4.75%	12/15/2024	5,078	5,233,429	0.4
Ally Financial, Inc.....	5.75%	11/20/2025	2,860	3,288,254	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(b).....	5.88%	05/24/2022	EUR 1,400	1,779,794	0.1
Banco Santander SA(b).....	6.75%	04/25/2022	2,800	3,573,107	0.3
CaixaBank SA(b).....	5.88%	10/09/2027	1,000	1,393,876	0.1
CIT Group, Inc.....	3.93%	06/19/2024	USD 518	548,553	0.0
CIT Group, Inc.....	5.00%	08/15/2022	1,986	2,086,847	0.2
CIT Group, Inc.....	5.00%	08/01/2023	945	1,027,373	0.1
Intesa Sanpaolo SpA.....	5.02%	06/26/2024	3,471	3,783,577	0.3
Intesa Sanpaolo SpA.....	5.71%	01/15/2026	2,289	2,591,186	0.2
Natwest Group PLC, Series U(b) (c).....	2.52%	09/30/2027	3,300	3,277,280	0.2
Societe Generale SA(b).....	8.00%	09/29/2025	1,975	2,319,515	0.2
UniCredit SpA(b).....	9.25%	06/03/2022	EUR 2,539	3,336,878	0.2
				<u>34,239,669</u>	<u>2.5</u>
MAKLER					
LPL Holdings, Inc.....	4.63%	11/15/2027	USD 510	532,562	0.0
NFP Corp.....	7.00%	05/15/2025	493	540,444	0.1
				<u>1,073,006</u>	<u>0.1</u>
FINANZEN					
Enova International, Inc.....	8.50%	09/15/2025	2,814	2,925,643	0.2
goeasy Ltd.....	4.38%	05/01/2026	1,943	1,968,572	0.2
goeasy Ltd.....	5.38%	12/01/2024	4,781	4,943,162	0.4
Lincoln Financing SARL.....	3.63%	04/01/2024	EUR 5,074	6,265,468	0.5
Navient Corp.....	5.50%	01/25/2023	USD 4,409	4,624,863	0.3
Navient Corp.....	6.50%	06/15/2022	455	476,408	0.0
Navient Corp.....	7.25%	09/25/2023	914	1,002,820	0.1
SLM Corp.....	4.20%	10/29/2025	4,631	4,908,131	0.4
SLM Corp.....	5.13%	04/05/2022	1,802	1,840,859	0.1
				<u>28,955,926</u>	<u>2.2</u>
VERSICHERUNGEN					
AmWINS Group, Inc.....	7.75%	07/01/2026	3,017	3,208,629	0.2
Centene Corp.....	5.38%	08/15/2026	3,889	4,068,483	0.3
				<u>7,277,112</u>	<u>0.5</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Intrum AB.....	2.75%	07/15/2022	EUR 233	284,010	0.0
Intrum AB.....	3.13%	07/15/2024	2,000	2,453,620	0.2
Intrum AB.....	3.50%	07/15/2026	1,346	1,662,230	0.1
Intrum AB.....	4.88%	08/15/2025	644	826,585	0.1
				<u>5,226,445</u>	<u>0.4</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
REITS						
	Aedas Homes Opco S1	4.00%	08/15/2026	USD 367	\$ 455,640	0.0%
	Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	5,471	6,073,552	0.4
	EPR Properties	5.25%	07/15/2023	697	729,579	0.1
	Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2027	3,772	3,907,126	0.3
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.63%	05/01/2024	5,977	6,433,354	0.5
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027	5,000	5,270,671	0.4
	MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.25%	08/01/2026	960	989,707	0.1
	Via Celere Desarrollos	5.25%	04/01/2026	EUR 1,486	1,875,867	0.1
	VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	4.25%	12/01/2026	USD 3,000	3,088,236	0.2
					<u>28,823,732</u>	<u>2.1</u>
					<u>105,595,890</u>	<u>7.8</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
	Calpine Corp.	4.50%	02/15/2028	3,936	3,977,979	0.3
	Calpine Corp.	5.25%	06/01/2026	1,399	1,439,770	0.1
	NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027	4,017	4,167,903	0.3
	Orano SA	4.88%	09/23/2024	EUR 1,150	1,586,510	0.1
	Vistra Operations Co. LLC	5.50%	09/01/2026	USD 5,937	6,134,620	0.5
					<u>17,306,782</u>	<u>1.3</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE						
	Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	2,878	3,014,788	0.2
					<u>20,321,570</u>	<u>1.5</u>
					<u>1,001,840,583</u>	<u>74.2</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
	Anglo American Capital PLC	3.63%	09/11/2024	4,336	4,704,385	0.3
	Glencore Finance Canada Ltd.	4.25%	10/25/2022	1,977	2,076,206	0.1
	Glencore Finance Europe Ltd.	1.88%	09/13/2023	EUR 910	1,151,486	0.1
	Glencore Funding LLC	4.13%	05/30/2023	USD 950	1,012,033	0.1
	Huntsman International LLC	5.13%	11/15/2022	2,635	2,771,857	0.2
	Smurfit Kappa Acquisitions ULC	2.88%	01/15/2026	EUR 1,631	2,199,200	0.2
					<u>13,915,167</u>	<u>1.0</u>
INVESTITIONSGÜTER						
	Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	3.20%	06/15/2025	USD 340	362,977	0.0
KOMMUNIKATIONS MEDIEN						
	Time Warner Cable LLC	4.00%	09/01/2021	2,643	2,649,907	0.2
	Walt Disney Co. (The)	4.00%	10/01/2023	542	586,404	0.1
					<u>3,236,311</u>	<u>0.3</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION						
	Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC.	4.74%	03/20/2025	4,813	5,163,136	0.4
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
	General Motors Co.	4.00%	04/01/2025	123	135,388	0.0
	General Motors Co.	4.88%	10/02/2023	251	274,573	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	2.20%	04/01/2024	EUR 946	1,219,535	0.1
	General Motors Financial Co., Inc.	3.25%	01/05/2023	USD 490	509,820	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	3.70%	05/09/2023	502	528,718	0.1
	General Motors Financial Co., Inc.	4.00%	10/06/2026	38	42,106	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	4.25%	05/15/2023	304	324,749	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	4.30%	07/13/2025	118	131,037	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	5.10%	01/17/2024	2,449	2,711,121	0.2
	General Motors Financial Co., Inc.	5.25%	03/01/2026	159	184,218	0.0
	General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029	415	501,612	0.0
	Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	273	291,754	0.0
	Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.88%	05/19/2023	EUR 2,600	3,405,941	0.3
	Nissan Motor Acceptance Corp.	2.60%	09/28/2022	USD 115	117,674	0.0
	Nissan Motor Acceptance Corp.	2.80%	01/13/2022	105	106,368	0.0
	Nissan Motor Acceptance Corp.	3.45%	03/15/2023	166	173,501	0.0
	Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	2,993	3,270,099	0.3
					<u>13,928,214</u>	<u>1.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
	Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc.	3.30%	02/15/2026	2,544	2,552,751	0.2
	Lennar Corp.	4.13%	01/15/2022	722	731,620	0.1
	Lennar Corp.	6.25%	12/15/2021	1,170	1,171,547	0.1

AB SICAV I
Short Duration High Yield Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Marriott International, Inc./MD, Series EE	5.75%	05/01/2025	USD 460	\$ 533,948	0.0%
PulteGroup, Inc.	5.00%	01/15/2027	1,879	2,199,637	0.1
PulteGroup, Inc.	5.50%	03/01/2026	780	916,354	0.1
				<u>8,105,857</u>	<u>0.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
PVH Corp.	4.63%	07/10/2025	1,125	1,261,406	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Imperial Brands Finance PLC	3.50%	07/26/2026	1,207	1,294,874	0.1
Sysco Corp.	5.65%	04/01/2025	1,000	1,168,051	0.1
Tesco PLC	6.13%	02/24/2022	GBP 222	328,089	0.0
				<u>2,791,014</u>	<u>0.2</u>
ENERGIE					
Cenovus Energy, Inc.	3.80%	09/15/2023	USD 325	343,379	0.0
Cenovus Energy, Inc.	4.25%	04/15/2027	1,515	1,683,332	0.1
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	1,349	1,539,753	0.1
Cheniere Corpus Christi Holdings LLC	7.00%	06/30/2024	3,728	4,286,793	0.3
Enable Midstream Partners LP	4.40%	03/15/2027	2,951	3,263,133	0.2
Enable Midstream Partners LP	4.95%	05/15/2028	478	542,091	0.0
Energy Transfer LP	4.25%	03/15/2023	2,117	2,230,135	0.2
Energy Transfer LP	3.90%	07/15/2026	1,105	1,208,921	0.1
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR 150,000	2,060,255	0.2
Marathon Petroleum Corp.	4.50%	05/01/2023	USD 632	676,515	0.1
Marathon Petroleum Corp.	4.70%	05/01/2025	546	619,091	0.0
Marathon Petroleum Corp.	4.75%	12/15/2023	2,019	2,212,975	0.2
ONEOK, Inc.	2.20%	09/15/2025	809	833,740	0.1
ONEOK, Inc.	2.75%	09/01/2024	836	883,971	0.1
ONEOK, Inc.	5.85%	01/15/2026	1,188	1,411,737	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.60%	11/01/2024	1,829	1,966,906	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	510	571,516	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.65%	10/15/2025	745	832,970	0.1
Williams Cos., Inc. (The)	3.35%	08/15/2022	3,959	4,070,153	0.3
Williams Cos., Inc. (The)	3.70%	01/15/2023	1,362	1,421,734	0.1
WPX Energy, Inc.	4.50%	01/15/2030	1,480	1,599,345	0.1
				<u>34,258,445</u>	<u>2.5</u>
Dienstleistungen					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	211	246,044	0.0
Technologie					
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028	3,683	4,077,642	0.3
Dell International LLC/EMC Corp.	6.02%	06/15/2026	596	711,181	0.1
Micron Technology, Inc.	4.98%	02/06/2026	499	575,966	0.0
NXP BV/NXP Funding LLC	4.63%	06/01/2023	2,302	2,485,153	0.2
				<u>7,849,942</u>	<u>0.6</u>
Transportwesen – Fluggesellschaften					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	1,783	2,074,346	0.2
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.50%	10/20/2025	1,889	2,032,703	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	2,299	2,524,107	0.2
Southwest Airlines Co.	4.75%	05/04/2023	1,351	1,456,313	0.1
Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025	1,405	1,611,341	0.1
				<u>9,698,810</u>	<u>0.7</u>
Transportwesen – Dienstleistungen					
United Rentals North America, Inc.	3.88%	11/15/2027	3,308	3,476,390	0.3
				<u>104,293,713</u>	<u>7.7</u>
Finanzinstitute					
Bankwesen					
ABN AMRO Bank NV, Series E	6.25%	04/27/2022	1,093	1,147,799	0.1
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	2,292	2,489,290	0.2
AIB Group PLC	4.75%	10/12/2023	1,083	1,181,014	0.1
Ally Financial, Inc.	4.13%	02/13/2022	869	891,379	0.1
BNP Paribas SA(b)	6.75%	03/14/2022	200	207,281	0.0
Capital One Bank USA NA	3.38%	02/15/2023	2,167	2,275,949	0.2
Citigroup Capital XVIII(c)	0.91%	06/28/2067	GBP 4,306	5,366,843	0.4
Credit Suisse Group Funding Guernsey Ltd.	1.25%	04/14/2022	EUR 4,237	5,228,267	0.4
HSBC Holdings PLC(b)	5.25%	09/16/2022	3,220	4,122,363	0.3
Lloyds Banking Group PLC(b)	7.63%	06/27/2023	GBP 1,940	3,007,428	0.2
Mizuho Financial Group, Inc.(c)	1.32%	09/13/2021	USD 2,779	2,787,841	0.2
Morgan Stanley	5.00%	11/24/2025	817	947,855	0.1
Natwest Group PLC	2.00%	03/04/2025	EUR 1,080	1,385,822	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	USD 1,592	\$ 1,787,829	0.1%
Standard Chartered PLC	5.20%	01/26/2024	1,913	2,107,782	0.1
UniCredit SpA	2.57%	09/22/2026	1,375	1,396,571	0.1
				<u>36,331,313</u>	<u>2.7</u>
FINANZEN					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	2.88%	08/14/2024	186	194,002	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023	150	155,699	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	10/01/2025	474	520,379	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025	214	250,014	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	237	233,071	0.0
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	70	74,534	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	21	22,744	0.0
Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023	172	184,354	0.0
Aircastle Ltd.	5.00%	04/01/2023	15	16,066	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	3,808	4,242,647	0.3
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	105	104,497	0.0
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022	1,025	1,036,346	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	537	562,249	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023	1,191	1,248,190	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	4	4,302	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	1,903	2,043,872	0.2
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	108	119,289	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	1,335	1,505,599	0.1
				<u>12,517,854</u>	<u>1.0</u>
VERSICHERUNGEN					
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(c)	2.28%	02/12/2047	2,690	2,585,933	0.2
SONSTIGE FINANZWERTE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	250	274,209	0.0
REITS					
Digital Euro Finco LLC	2.50%	01/16/2026	EUR 1,594	2,134,733	0.2
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	3.35%	09/01/2024	USD 1,819	1,929,748	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	689	778,404	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	11/01/2023	3,785	4,145,200	0.3
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026	263	300,585	0.0
Office Properties Income Trust	4.50%	02/01/2025	649	701,730	0.1
Omega Healthcare Investors, Inc.	4.38%	08/01/2023	318	340,666	0.0
Spirit Realty LP	4.45%	09/15/2026	1,335	1,496,045	0.1
Vornado Realty LP	2.15%	06/01/2026	3,313	3,347,002	0.2
				<u>15,174,113</u>	<u>1.1</u>
				<u>66,883,422</u>	<u>5.0</u>
				<u>171,177,135</u>	<u>12.7</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2019-R05, Class 1M2(c)	2.09%	07/25/2039	244	244,814	0.0
Series 2020-SBT1, Class 2M2(c)	3.74%	02/25/2040	192	198,146	0.0
Eagle Re Ltd., Series 2019-1, Class M2(c)	3.39%	04/25/2029	374	377,223	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency					
Credit Risk Debt Notes					
Series 2013-DN2, Class M2(c)	4.34%	11/25/2023	128	130,733	0.0
Series 2014-DN3, Class M3(c)	4.09%	08/25/2024	90	91,722	0.0
Series 2015-DNA1, Class M3(c)	3.39%	10/25/2027	144	146,561	0.0
Series 2015-DNA2, Class M3(c)	3.99%	12/25/2027	850	864,293	0.1
Series 2015-DNA3, Class M3(c)	4.79%	04/25/2028	550	569,291	0.1
Series 2015-HQA1, Class M3(c)	4.79%	03/25/2028	619	640,348	0.1
Series 2016-DNA1, Class M3(c)	5.64%	07/25/2028	195	204,648	0.0
Series 2016-DNA3, Class M3(c)	5.09%	12/25/2028	196	206,529	0.0
Series 2016-DNA4, Class M3(c)	3.89%	03/25/2029	2,286	2,374,675	0.2
Series 2016-HQA2, Class M3(c)	5.24%	11/25/2028	1,027	1,075,414	0.1
Series 2016-HQA3, Class M3(c)	3.94%	03/25/2029	636	661,114	0.1
Series 2016-HQA4, Class M3(c)	3.99%	04/25/2029	1,765	1,832,901	0.1
Series 2017-DNA2, Class M2(c)	3.54%	10/25/2029	2,767	2,883,917	0.2
Series 2017-DNA3, Class M2(c)	2.59%	03/25/2030	2,428	2,480,887	0.2
Series 2017-HQA1, Class M2(c)	3.64%	08/25/2029	1,973	2,038,887	0.2
Series 2018-HQA1, Class M2(c)	2.39%	09/25/2030	138	138,697	0.0
Series 2018-HQA2, Class M2(c)	2.39%	10/25/2048	2,103	2,123,648	0.2
Series 2019-DNA1, Class M2(c)	2.74%	01/25/2049	445	453,378	0.0
Series 2019-DNA3, Class M2(c)	2.14%	07/25/2049	363	367,649	0.0
Series 2020-HQA2, Class M2(c)	3.19%	03/25/2050	106	107,818	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Federal National Mortgage Association Connecticut					
Avenue Securities					
Series 2014-C04, Class 1M2(c)	4.99%	11/25/2024	USD 555	\$ 573,296	0.1%
Series 2015-C03, Class 2M2(c)	5.09%	07/25/2025	195	197,937	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(c)	5.79%	04/25/2028	219	232,005	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(c)	5.64%	04/25/2028	262	276,503	0.0
Series 2016-C01, Class 1M2(c)	6.84%	08/25/2028	1,520	1,627,979	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(c)	7.04%	08/25/2028	245	260,826	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(c)	6.09%	09/25/2028	469	494,024	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(c)	5.39%	10/25/2028	157	164,829	0.0
Series 2016-C03, Class 2M2(c)	5.99%	10/25/2028	584	616,029	0.1
Series 2016-C04, Class 1M2(c)	4.34%	01/25/2029	1,063	1,107,136	0.1
Series 2016-C05, Class 2M2(c)	4.54%	01/25/2029	453	472,369	0.0
Series 2016-C06, Class 1M2(c)	4.34%	04/25/2029	441	459,931	0.0
Series 2016-C07, Class 1M2(c)	4.44%	05/25/2029	406	425,273	0.0
Series 2017-C01, Class 1M2(c)	3.64%	07/25/2029	1,845	1,913,783	0.2
Series 2017-C02, Class 2M2(c)	3.74%	09/25/2029	185	191,716	0.0
Series 2017-C03, Class 1M2(c)	3.09%	10/25/2029	171	175,427	0.0
Series 2017-C05, Class 1M2(c)	2.29%	01/25/2030	184	186,792	0.0
Series 2018-C04, Class 2M2(c)	2.64%	12/25/2030	243	247,907	0.0
Mortgage Insurance-Linked Notes, Series 2019-1, Class M2(c)	2.99%	11/26/2029	2,880	2,880,412	0.2
Oaktown Re III Ltd., Series 2019-1A, Class M2(c)	2.64%	07/25/2029	1,608	1,615,053	0.1
Radnor Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M2(c)	2.79%	03/25/2028	150	150,236	0.0
Series 2019-1, Class M2(c)	3.29%	02/25/2029	1,205	1,222,329	0.1
STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class M2(c)	2.19%	09/25/2048	1,746	1,766,338	0.1
				<u>37,471,423</u>	<u>2.8</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025	2,960	2,982,011	0.2
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023	370	384,176	0.1
Eldorado Gold Corp.	9.50%	06/01/2024	1,584	1,726,510	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	04/01/2023	1,585	1,616,700	0.1
				<u>6,709,397</u>	<u>0.5</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC	7.50%	10/15/2026	3,802	4,003,777	0.3
MTN Mauritius Investments Ltd.	5.37%	02/13/2022	2,790	2,858,529	0.2
VTR Comunicaciones SpA	5.13%	01/15/2028	610	628,453	0.0
				<u>7,490,759</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	2,000	2,106,086	0.2
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024	491	504,456	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	514	540,118	0.0
Studio City Finance Ltd.	6.00%	07/15/2025	1,467	1,541,542	0.1
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	3,399	3,456,995	0.3
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	839	879,293	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	281	295,440	0.0
				<u>9,323,930</u>	<u>0.7</u>
				<u>23,524,086</u>	<u>1.7</u>
FINANZINSTITUTE					
VERSICHERUNGEN					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./Highlands Holdings					
Bond Co-Issuer, Inc.(a)	7.63%	10/15/2025	1,849	1,962,017	0.2
				<u>25,486,103</u>	<u>1.9</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
KATAR					
Qatar Government International Bond.	3.88%	04/23/2023	1,799	1,916,000	0.1
SAUDI ARABIEN					
Saudi Government International Bond	4.00%	04/17/2025	3,255	3,595,272	0.3
				<u>5,511,272</u>	<u>0.4</u>
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
DB Master Finance LLC, Series 2017-1A, Class A2I	3.63%	11/20/2047	2,671	2,710,802	0.2
Wendy's Funding LLC, Series 2018-1A, Class A2I	3.57%	03/15/2048	1,883	1,927,640	0.1
				<u>4,638,442</u>	<u>0.3</u>

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
	Dominican Republic International Bond	16.95%	02/04/2022	DOP	70,900	\$ 1,341,096 0.1%
SÜDAFRIKA						
	Republic of South Africa Government Bond, Series 2023	7.75%	02/28/2023	ZAR	12,994	985,597 0.1
					2,326,693 0.2	
					1,248,451,651 92.5	
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN						
CLO – VARIABLE VERZINSLICH						
	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd. Series 2014-9A, Class DR2 (c)	3.18%	10/29/2029	USD	2,540	2,525,672 0.2
	Greywolf CLO VI Ltd. Series 2018-1A, Class A1 (c)	1.21%	04/26/2031		2,700	2,693,693 0.2
	Sound Point CLO XIX Ltd. Series 2018-1A, Class A (c)	1.18%	04/15/2031		2,700	2,701,293 0.2
					7,920,658 0.6	
STAMMAKTIE						
	Carlson Travel, Inc. (d)				651	0 0.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
	ABN AMRO Bank NV	7.75%	05/15/2023		400	448,056 0.0
REITS						
	Sabra Health Care LP	4.80%	06/01/2024		2,000	2,193,237 0.2
					2,641,293 0.2	
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
	Natwest Group PLC(b)	8.63%	08/15/2021		2,530	2,565,126 0.2
REITS						
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	4.88%	06/01/2023		3,294	3,425,815 0.3
	VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	3.50%	02/15/2025		3,177	3,234,839 0.2
					6,660,654 0.5	
					9,225,780 0.7	
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
	Kleopatra Finco SARL	4.25%	03/01/2026	EUR	3,816	4,655,787 0.4
INVESTITIONSGÜTER						
	RBS Global, Inc./Rexnord LLC	4.88%	12/15/2025	USD	3,485	3,559,626 0.3
	Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	EUR	2,638	3,338,727 0.3
	Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026	USD	3,000	3,207,154 0.2
					10,105,507 0.8	
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
	Banjay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025	EUR	353	433,806 0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG						
	Six Flags Entertainment Corp.	4.88%	07/31/2024	USD	1,650	1,668,286 0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
	Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025		4,320	4,605,267 0.3
DIENSTLEISTUNGEN						
	Carlson Travel, Inc.	6.75%	12/15/2025		3,677	3,178,547 0.2
	Carlson Travel, Inc.	10.50%	03/31/2025		651	679,530 0.1
					3,858,077 0.3	
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
	XPO Logistics, Inc.	6.13%	09/01/2023		5,339	5,395,734 0.4
					30,722,464 2.3	
					39,948,244 3.0	
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
RUSSLAND						
	Russian Federal Bond - OFZ Series 6217	7.50 %	08/18/2021	RUB	111,994	1,536,346 0.1
					52,046,541 3.9	
Gesamtanlagen						
	(Kosten \$1,256,385,114)					\$ 1,300,498,192 96.4%

AB SICAV I
Short Duration High Yield Portfolio

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Termineinlagen				
ANZ, London(e)	0.01 %	—	\$ 19,070,569	1.4%
Bank of Nova Scotia, Toronto(e)	0.01 %	—	2,185	0.0
BNP Paribas, Paris(e)	0.00 %	—	81	0.0
BNP Paribas, Paris(e)	0.01 %	—	2	0.0
BNP Paribas, Paris(e)	2.99 %	—	31	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(e)	(0.78)%	—	12,202	0.0
Sumitomo, London (e)	0.01 %	—	64,036	0.0
Termineinlagen insgesamt			<u>19,149,106</u>	<u>1.4</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>29,470,211</u>	<u>2.2</u>
Nettovermögen			<u>\$ 1,349,117,509</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	852	\$ 105,341,000	\$ 105,521,532	\$ 180,532
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	56	7,377,125	7,388,500	11,375
Short					
Euro-BOBL Futures	06/08/2021	139	22,884,674	22,838,908	45,766
					<u>\$ 237,673</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	ZAR 9,349	USD 638	06/17/2021	\$ (39,516)
Bank of America, NA.	RUB 128,374	USD 1,728	07/28/2021	(10,412)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 10,161	USD 14,001	06/17/2021	(418,744)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 1,098	USD 1,341	08/03/2021	(330)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 820	USD 1,003	08/03/2021	1,816
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,767	AUD 4,856	06/30/2021	(23,658)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,636	CAD 1,982	06/30/2021	4,670
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 16,347	CHF 14,649	06/30/2021	(49,345)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 62,837	EUR 51,388	06/30/2021	(137,764)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,075	GBP 3,587	06/30/2021	16,289
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,547	SGD 2,050	06/30/2021	2,515
Deutsche Bank AG.	INR 145,277	USD 1,952	07/15/2021	(39,248)
HSBC Bank USA.	EUR 89,010	USD 109,191	08/03/2021	514,118
				<u>\$ (179,609)</u>
			Wertsteigerung	\$ 539,408
			Wertminderung	\$ (719,017)

+ 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)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025	USD 3,787	\$ 365,416	\$ 373,713
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025	16,351	1,588,883	825,700
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	06/20/2026	63,412	6,132,150	365,782
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	iTraxx Europe Crossover Series 35, 5 Year Index	06/20/2026	EUR 3,510	505,989	77,828
Insgesamt				<u>\$ 8,592,438</u>	<u>\$ 1,643,023</u>

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 24,520	12/16/2026	2.342%	3 Month LIBOR	<u>\$ (1,803,471)</u>

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 3,950	\$1,877,604	\$1,832,913	\$ 44,691
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,227	1,058,261	266,411	791,850
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,949	2,352,204	599,397	1,752,807
Verkaufskontrakte						
Credit Suisse International	International Game Technology	06/20/2022	EUR 1,530	87,718	33,372	54,346
Credit Suisse International	International Game Technology	06/20/2022	1,840	105,491	44,064	61,427
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 1,159	(326,028)	(74,361)	(251,667)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,863	(1,086,662)	(254,440)	(832,222)
Goldman Sachs International	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	660	62,179	33,974	28,205
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,467	(1,647,929)	(423,308)	(1,224,621)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,467	(1,647,929)	(412,253)	(1,235,676)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,250	(2,020,079)	(481,054)	(1,539,025)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	168	(47,259)	(10,769)	(36,490)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,550	(998,615)	(240,521)	(758,094)
JPMorgan Chase Bank, NA	Rolls-Royce PLC	06/20/2025	EUR 1,081	(70,220)	(174,797)	104,577
JPMorgan Chase Bank, NA	Rolls-Royce PLC	06/20/2025	1,149	(74,637)	(186,846)	112,209
Insgesamt				<u>\$(2,375,901)</u>	<u>\$ 551,782</u>	<u>\$ (2,927,683)</u>
					Wertsteigerung	\$ 2,950,112
					Wertminderung	\$ (5,877,795)

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					
JPMorgan Chase Bank, NA					
iBoxx \$ Liquid High Yield Index	1,560,000	3 Month LIBOR	USD 1,560	09/20/2021	\$ 30,011
Swaps insgesamt					<u>\$ (3,058,120)</u>

- (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 2021.
- (d) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.
- (e) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
 CAD – Canadian Dollar
 CHF – Swiss Franc
 DOP – Dominican Peso
 EUR – Euro
 GBP – Great British Pound
 INR – Indian Rupee
 RUB – Russian Ruble
 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
CLO	–	Collateralized Loan Obligations
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 GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS- AUSRÜSTUNG			
F5 Networks, Inc.	142,092	\$ 26,348,120	0.7%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
PayPal Holdings, Inc.	105,743	27,495,295	0.8
Visa, Inc. - Class A	334,508	76,033,668	2.1
		<u>103,528,963</u>	<u>2.9</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Advanced Micro Devices, Inc.	349,803	28,012,224	0.8
Broadcom, Inc.	75,247	35,541,416	1.0
Intel Corp.	481,228	27,487,743	0.8
NVIDIA Corp.	47,758	31,032,193	0.9
NXP Semiconductors NV	176,554	37,327,047	1.0
Texas Instruments, Inc.	216,585	41,112,165	1.1
		<u>200,512,788</u>	<u>5.6</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	78,042	39,378,432	1.1
Microsoft Corp.	802,613	200,396,414	5.6
Oracle Corp.	434,021	34,174,814	1.0
		<u>273,949,660</u>	<u>7.7</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	1,398,461	174,262,225	4.9
		<u>778,601,756</u>	<u>21.8</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of America Corp.	679,403	28,799,893	0.8
Fifth Third Bancorp	1,633,363	68,829,917	1.9
JPMorgan Chase & Co.	316,664	52,008,896	1.5
PNC Financial Services Group, Inc. (The)	322,612	62,806,104	1.8
Wells Fargo & Co.	396,161	18,508,642	0.5
		<u>230,953,452</u>	<u>6.5</u>
KAPITALMÄRKTE			
Apollo Global Management, Inc.	565,822	32,444,233	0.9
BlackRock, Inc. - Class A	37,104	32,541,692	0.9
Charles Schwab Corp. (The)	767,492	56,679,284	1.6
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	307,429	114,369,737	3.2
		<u>236,034,946</u>	<u>6.6</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Berkshire Hathaway, Inc. - Class B	456,775	132,208,956	3.7
		<u>599,197,354</u>	<u>16.8</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Howmet Aerospace, Inc.	705,334	25,025,250	0.7
Raytheon Technologies Corp.	715,050	63,432,086	1.8
		<u>88,457,336</u>	<u>2.5</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
Honeywell International, Inc.	647,792	149,581,651	4.2
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Jacobs Engineering Group, Inc.	348,481	49,512,180	1.4
STRASSE UND SCHIENE			
Norfolk Southern Corp.	418,330	117,508,897	3.3
Union Pacific Corp.	433,518	97,424,500	2.7
		<u>214,933,397</u>	<u>6.0</u>
		<u>502,484,564</u>	<u>14.1</u>
KOMMUNIKATIONS- DIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONS- DIENSTE			
Comcast Corp. - Class A	1,020,692	58,526,479	1.6
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	383,698	37,314,630	1.0
Netflix, Inc.	35,876	18,038,812	0.5
Walt Disney Co. (The)	172,777	30,866,611	0.9
		<u>86,220,053</u>	<u>2.4</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	61,557	148,448,399	4.2
Facebook, Inc. - Class A	437,609	143,855,207	4.0
		<u>292,303,606</u>	<u>8.2</u>

		Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE				
	T-Mobile US, Inc.	218,001	\$ 30,836,241	0.9%
			<u>467,886,379</u>	<u>13.1</u>
GESUNDHEITSWESEN				
BIOTECHNOLOGIE				
	Vertex Pharmaceuticals, Inc.	41,164	8,588,045	0.2
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF				
	Abbott Laboratories	365,665	42,654,822	1.2
	Danaher Corp.	177,970	45,585,236	1.3
	Zimmer Biomet Holdings, Inc.	212,525	35,774,333	1.0
			<u>124,014,391</u>	<u>3.5</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN				
	Humana, Inc.	79,306	34,712,236	1.0
	Quest Diagnostics, Inc.	192,793	25,385,055	0.7
	UnitedHealth Group, Inc.	183,635	75,642,929	2.1
			<u>135,740,220</u>	<u>3.8</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN				
	IQVIA Holdings, Inc.	186,561	44,804,490	1.2
PHARMAZEUTIKA				
	Eli Lilly & Co.	174,759	34,906,362	1.0
	Johnson & Johnson	441,291	74,688,502	2.1
	Merck & Co., Inc.	475,657	36,097,610	1.0
			<u>145,692,474</u>	<u>4.1</u>
			<u>458,839,620</u>	<u>12.8</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER				
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT				
	Booking Holdings, Inc.	12,348	29,160,419	0.8
	McDonald's Corp.	178,725	41,801,990	1.2
			<u>70,962,409</u>	<u>2.0</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB				
	Amazon.com, Inc.	33,516	108,024,414	3.0
MULTILINE-EINZELHANDEL				
	Dollar General Corp.	20,616	4,184,224	0.1
	Target Corp.	123,021	27,915,925	0.8
			<u>32,100,149</u>	<u>0.9</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL				
	Home Depot, Inc. (The)	154,744	49,349,409	1.4
	Lowe's Cos., Inc.	311,794	60,746,825	1.7
	Ross Stores, Inc.	196,953	24,892,890	0.7
			<u>134,989,124</u>	<u>3.8</u>
			<u>346,076,096</u>	<u>9.7</u>
ENERGIE				
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE				
	Chevron Corp.	368,312	38,227,103	1.1
	EOG Resources, Inc.	510,874	41,043,617	1.1
	Exxon Mobil Corp.	830,779	48,492,570	1.4
	Pioneer Natural Resources Co.	198,363	30,188,865	0.8
			<u>157,952,155</u>	<u>4.4</u>
VERBRAUCHSGÜTER				
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL				
	Costco Wholesale Corp.	54,476	20,606,637	0.6
	Walmart, Inc.	173,910	24,700,437	0.7
			<u>45,307,074</u>	<u>1.3</u>
HAUSHALTSPRODUKTE				
	Procter & Gamble Co. (The)	561,102	75,664,605	2.1
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE				
	Estee Lauder Cos., Inc. (The) - Class A	95,830	29,373,812	0.8
	Honest Co., Inc. (The)	262,950	4,149,350	0.1
			<u>33,523,162</u>	<u>0.9</u>
			<u>154,494,841</u>	<u>4.3</u>
VERSORGUNG				
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE				
	NextEra Energy, Inc.	400,787	29,345,624	0.8
			<u>3,494,878,389</u>	<u>97.8</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
VORZUGSAKTIE					
VERBRAUCHSGÜTER					
Dream Holdings, Inc., Series D (a)	0.00%		1,394,469	\$ 9,949,536	0.3%
Dream Holdings, Inc., Series 2 (a)	0.00%		257,130	2,645,868	0.1
				12,595,404	0.4
Gesamtanlagen				\$ 3,507,473,793	98.2%
(Kosten \$2,873,929,436)					
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	(0.13)%	—		154	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(b)	0.01 %	—		9	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	—		668,721	0.0
MUFG, Tokyo(b)	(0.29)%	—		215,022	0.0
SEB, Stockholm(b)	0.01 %	—		72,997,102	2.1
Sumitomo, London(b)	0.01 %	—		990,569	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.78)%	—		697,018	0.0
Termineinlagen insgesamt				75,568,595	2.1
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(9,917,511)	(0.3)
Nettovermögen				\$ 3,573,124,877	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 474,489	EUR 390,846	06/07/2021	\$ 2,170,959
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 17	SGD 23	06/07/2021	77
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 11,594	AUD 14,986	06/21/2021	(40,754)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 271	CZK 5,649	06/21/2021	(267)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 202	PLN 747	06/21/2021	1,479
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 11,531	CHF 10,333	06/30/2021	(34,743)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 19,536	GBP 13,810	06/30/2021	62,534
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 17,053	JPY 1,855,817	06/30/2021	(152,788)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,866	SGD 5,121	06/30/2021	6,281
				\$ 2,012,778
			Wertsteigerung	\$ 2,241,330
			Wertminderung	\$ (228,552)

+ 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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE						
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
AUSTRALIEN						
	Australia Government Bond, Series 144	3.75%	04/21/2037	AUD 11,900	\$ 11,184,549	1.1%
	Australia Government Bond, Series 145	2.75%	06/21/2035	7,511	6,329,365	0.6
	Australia Government Bond, Series 150	3.00%	03/21/2047	7,855	6,578,998	0.7
	Australia Government Bond, Series 160	1.00%	12/21/2030	4,025	2,943,947	0.3
	Australia Government Bond, Series 161	0.25%	11/21/2025	16,415	12,456,260	1.2
	Australia Government Bond, Series 162	1.75%	06/21/2051	3,465	2,191,617	0.2
	Australia Government Bond, Series 164	0.50%	09/21/2026	9,400	7,126,726	0.7
					<u>48,811,462</u>	<u>4.8</u>
ÖSTERREICH						
	Republic of Austria Government Bond	0.75%	02/20/2028	EUR 5,445	7,095,793	0.7
BELGIEN						
	Kingdom of Belgium Government Bond, Series 76	1.90%	06/22/2038	2,675	3,975,535	0.4
KANADA						
	Canadian Government Bond	0.25%	03/01/2026	CAD 2,370	1,902,415	0.2
CHINA						
	China Government Bond, Series INBK	3.39%	03/16/2050	CNY 44,580	6,663,459	0.7
	China Government Bond, Series INBK	3.81%	09/14/2050	40,000	6,483,919	0.6
					<u>13,147,378</u>	<u>1.3</u>
KOLUMBIEN						
	Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP 13,251,800	3,432,995	0.3
FINNLAND						
	Finland Government Bond	0.50%	09/15/2029	EUR 1,790	2,295,841	0.2
FRANKREICH						
	French Republic Government Bond OAT	0.50%	06/25/2044	3,894	4,492,281	0.4
DEUTSCHLAND						
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	02/15/2031	9,930	12,325,317	1.2
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	05/15/2035	3,260	3,941,112	0.4
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007	4.25%	07/04/2039	760	1,615,693	0.2
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series G	0.00%	08/15/2050	11,505	12,667,425	1.2
					<u>30,549,547</u>	<u>3.0</u>
ITALIEN						
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.95%	09/15/2027	25,165	31,741,537	3.1
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.50%	04/30/2045	7,705	9,024,290	0.9
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.80%	03/01/2041	2,984	3,760,412	0.4
					<u>44,526,239</u>	<u>4.4</u>
JAPAN						
	Japan Government Five Year Bond, Series 134	0.10%	12/20/2022	JPY 1,083,250	9,897,829	1.0
	Japan Government Ten Year Bond, Series 358	0.10%	03/20/2030	197,250	1,807,691	0.2
	Japan Government Ten Year Bond, Series 359	0.10%	06/20/2030	2,933,800	26,855,511	2.6
	Japan Government Ten Year Bond, Series 360	0.10%	09/20/2030	1,667,300	15,243,287	1.5
	Japan Government Thirty Year Bond, Series 62	0.50%	03/20/2049	1,232,500	10,851,757	1.1
	Japan Government Thirty Year Bond, Series 65	0.40%	12/20/2049	407,250	3,468,243	0.3
	Japan Government Thirty Year Bond, Series 68	0.60%	09/20/2050	862,200	7,716,306	0.8
	Japan Government Twenty Year Bond, Series 150	1.40%	09/20/2034	1,172,800	12,338,671	1.2
	Japan Government Twenty Year Bond, Series 159	0.60%	12/20/2036	286,200	2,723,915	0.3
	Japan Government Twenty Year Bond, Series 171	0.30%	12/20/2039	418,800	3,731,283	0.4
	Japan Government Two Year Bond, Series 414	0.10%	07/01/2022	1,000,350	9,131,229	0.9
					<u>103,765,722</u>	<u>10.3</u>
MALAYSIA						
	Malaysia Government Bond, Series 0310	4.50%	04/15/2030	MYR 14,032	3,695,595	0.4
MEXIKO						
	Mexican Bonos, Series M	7.75%	05/29/2031	MXN 291,550	15,767,347	1.6
SPANIEN						
	Spain Government Bond	1.20%	10/31/2040	EUR 5,980	7,327,916	0.7
	Spain Government Bond	4.20%	01/31/2037	1,530	2,765,268	0.3
					<u>10,093,184</u>	<u>1.0</u>
THAILAND						
	Thailand Government Bond	1.59%	12/17/2035	THB 72,700	2,154,172	0.2
VEREINIGTES KÖNIGREICH						
	United Kingdom Gilt	1.75%	09/07/2037	GBP 6,894	10,598,100	1.1
VEREINIGTE STAATEN						
	U.S. Treasury Bonds	1.13%	05/15/2040	USD 7,510	6,273,197	0.6
	U.S. Treasury Bonds	1.13%	08/15/2040	22,815	18,986,358	1.9
	U.S. Treasury Bonds	1.88%	02/15/2051	8,878	8,095,626	0.8
	U.S. Treasury Bonds(a)	4.50%	08/15/2039	8,525	11,713,883	1.2
	U.S. Treasury Notes	0.25%	05/31/2025	6,955	6,868,062	0.7

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
U.S. Treasury Notes	0.50%	02/28/2026	USD 6,350	\$ 6,276,578	0.6%
U.S. Treasury Notes	1.63%	10/31/2026	41,445	43,025,091	4.2
U.S. Treasury Notes	2.13%	05/31/2026	14,910	15,879,150	1.6
				<u>117,117,945</u>	<u>11.6</u>
				<u>423,421,551</u>	<u>41.9</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	4.40%	03/27/2028	2,200	2,322,678	0.2
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	4.40%	05/19/2026	1,739	1,966,195	0.2
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025	1,400	1,604,900	0.2
Bank of America Corp.	0.58%	08/24/2028	EUR 3,445	4,217,716	0.4
Bank of America Corp.	1.78%	05/04/2027	562	735,763	0.1
BNP Paribas SA	2.87%	04/19/2032	USD 2,114	2,138,422	0.2
BNP Paribas SA(b)	6.75%	03/14/2022	2,425	2,513,288	0.3
BPCE SA	4.63%	07/11/2024	280	309,012	0.0
BPCE SA	5.70%	10/22/2023	1,973	2,196,489	0.2
CaixaBank SA	0.50%	02/09/2029	EUR 2,000	2,385,353	0.2
Citigroup, Inc.	1.25%	07/06/2026	2,161	2,748,879	0.3
Citigroup, Inc.	1.50%	07/24/2026	137	175,769	0.0
Citigroup, Inc., Series W(b)	4.00%	12/10/2025	USD 488	497,618	0.1
Cooperatieve Rabobank UA(b)	4.38%	06/29/2027	EUR 1,800	2,413,902	0.2
Credit Suisse Group AG	4.19%	04/01/2031	USD 1,811	2,011,236	0.2
Danske Bank A/S	3.24%	12/20/2025	2,265	2,424,700	0.2
Danske Bank A/S	5.38%	01/12/2024	205	228,613	0.0
DNB Bank ASA(b)	6.50%	03/26/2022	2,910	3,024,661	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	0.13%	08/19/2024	EUR 876	1,069,756	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	1.25%	05/01/2025	370	466,495	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.13%	09/30/2024	1,042	1,355,717	0.1
HSBC Holdings PLC(b)	6.38%	03/30/2025	USD 1,489	1,649,068	0.2
ING Groep NV	1.73%	04/01/2027	565	571,752	0.1
ING Groep NV	2.73%	04/01/2032	1,065	1,082,043	0.1
ING Groep NV(b)	6.88%	04/16/2022	1,789	1,863,700	0.2
Intesa Sanpaolo SpA	3.13%	07/14/2022	1,955	2,010,600	0.2
JPMorgan Chase & Co.	1.09%	03/11/2027	EUR 1,269	1,608,288	0.2
JPMorgan Chase & Co.	2.58%	04/22/2032	USD 985	995,159	0.1
JPMorgan Chase & Co.	3.78%	02/01/2028	1,639	1,826,283	0.2
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	0.98%	06/09/2024	EUR 588	740,597	0.1
Morgan Stanley	0.41%	10/29/2027	985	1,200,482	0.1
Morgan Stanley, Series G	1.38%	10/27/2026	2,195	2,833,652	0.3
Natwest Group PLC	0.78%	02/26/2030	2,295	2,782,023	0.3
Natwest Group PLC	5.08%	01/27/2030	USD 255	298,787	0.0
Standard Chartered PLC(b) (c)	1.70%	01/30/2027	2,000	1,920,978	0.2
Standard Chartered PLC	5.20%	01/26/2024	745	820,856	0.1
Swedbank AB(b)	6.00%	03/17/2022	1,400	1,443,925	0.1
Swedbank AB, Series NC5(b)	5.63%	09/17/2024	200	216,486	0.0
Truist Financial Corp., Series Q(b)	5.10%	03/01/2030	1,018	1,138,278	0.1
UBS Group AG(b)	5.75%	02/19/2022	EUR 1,770	2,234,197	0.2
UniCredit SpA	2.57%	09/22/2026	USD 2,318	2,354,365	0.2
UniCredit SpA	3.13%	06/03/2032	1,440	1,435,814	0.1
Wells Fargo & Co.	1.38%	10/26/2026	EUR 850	1,092,966	0.1
				<u>68,927,461</u>	<u>6.8</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series I(b)	4.00%	06/01/2026	USD 2,317	2,412,167	0.3
FINANZEN					
Air Lease Corp.	2.88%	01/15/2026	558	584,434	0.1
Air Lease Corp.	3.25%	03/01/2025	161	170,933	0.0
Air Lease Corp.	3.63%	04/01/2027	120	128,584	0.0
Air Lease Corp.	3.88%	07/03/2023	91	96,706	0.0
Air Lease Corp.	4.25%	02/01/2024	256	277,830	0.0
Air Lease Corp.	4.63%	10/01/2028	212	236,988	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	720	708,064	0.1
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	342	364,154	0.1
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	83	89,893	0.0
Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023	862	923,911	0.1
Aircastle Ltd.	5.00%	04/01/2023	71	76,046	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	861	959,275	0.1
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022	60	60,664	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	212	221,968	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023	381	399,295	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	6	6,453	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	300	322,208	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	147	162,365	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	841	948,471	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
GE Capital European Funding Unlimited Co.....	4.63%	02/22/2027	EUR 400	\$ 603,321	0.1%
GE Capital Funding LLC.....	4.40%	05/15/2030	USD 2,785	3,205,110	0.3
Synchrony Financial	3.95%	12/01/2027	1,006	1,112,386	0.1
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025	1,195	1,340,445	0.1
				<u>12,999,504</u>	<u>1.3</u>
VERSICHERUNGEN					
Alleghany Corp.....	3.63%	05/15/2030	1,190	1,299,810	0.1
Assicurazioni Generali SpA.....	5.00%	06/08/2048	EUR 1,237	1,802,911	0.2
Centene Corp.	4.25%	12/15/2027	USD 282	296,212	0.0
Centene Corp.	4.63%	12/15/2029	370	400,207	0.1
Chubb INA Holdings, Inc.....	0.30%	12/15/2024	EUR 987	1,214,119	0.1
Chubb INA Holdings, Inc.....	0.88%	06/15/2027	1,685	2,124,599	0.2
CNP Assurances	2.50%	06/30/2051	1,900	2,455,661	0.3
Credit Agricole Assurances SA(b).....	4.25%	01/13/2025	700	947,884	0.1
Credit Agricole Assurances SA	4.75%	09/27/2048	900	1,335,454	0.1
Friends Life Holdings PLC	8.25%	04/21/2022	GBP 690	1,045,998	0.1
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR 1,120	1,405,200	0.1
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen ...	6.63%	05/26/2042	GBP 400	599,990	0.1
Nationwide Mutual Insurance Co.....	9.38%	08/15/2039	USD 345	581,932	0.1
Voya Financial, Inc.	5.65%	05/15/2053	1,876	1,994,184	0.2
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.....	3.00%	04/19/2051	1,385	1,357,470	0.1
				<u>18,861,631</u>	<u>1.9</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	235	257,757	0.0
REITS					
CyrusOne LP/CyrusOne Finance Corp.....	1.45%	01/22/2027	EUR 528	654,708	0.1
Digital Dutch Finco BV	1.00%	01/15/2032	638	760,767	0.1
Digital Euro Finco LLC	2.50%	01/16/2026	1,646	2,204,373	0.2
Vornado Realty LP	3.40%	06/01/2031	USD 893	902,786	0.1
WPC Eurobond BV	1.35%	04/15/2028	EUR 1,225	1,540,305	0.1
WPC Eurobond BV	2.13%	04/15/2027	989	1,301,804	0.1
				<u>7,364,743</u>	<u>0.7</u>
				<u>110,823,263</u>	<u>11.0</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Alpek SAB de CV	3.25%	02/25/2031	USD 525	524,344	0.1
AngloGold Ashanti Holdings PLC	3.75%	10/01/2030	325	336,375	0.0
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.....	5.13%	05/15/2024	1,023	1,114,303	0.1
Inversiones CMPC SA	3.85%	01/13/2030	1,834	1,951,834	0.2
Minera y Metalurgica del Boleo SAPI de CV	3.25%	04/17/2024	2,545	2,710,107	0.3
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	929	1,011,118	0.1
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	391	405,570	0.0
				<u>8,053,651</u>	<u>0.8</u>
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co.....	1.88%	05/28/2027	EUR 118	155,038	0.0
Wabtec Transportation Netherlands BV.....	1.25%	12/03/2027	932	1,138,244	0.1
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	3.20%	06/15/2025	USD 160	170,813	0.0
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	4.40%	03/15/2024	654	712,742	0.1
				<u>2,176,837</u>	<u>0.2</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	4.80%	03/01/2050	196	215,490	0.0
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	5.13%	07/01/2049	340	388,713	0.0
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	5.38%	05/01/2047	490	571,317	0.1
Discovery Communications LLC	4.65%	05/15/2050	188	209,631	0.0
Discovery Communications LLC	5.30%	05/15/2049	494	590,689	0.1
Fox Corp.	4.71%	01/25/2029	2,622	3,047,206	0.3
Prosus NV	3.68%	01/21/2030	2,089	2,207,290	0.2
ViacomCBS, Inc.	3.70%	06/01/2028	1,284	1,409,012	0.2
Weibo Corp.....	3.38%	07/08/2030	1,382	1,398,150	0.1
				<u>10,037,498</u>	<u>1.0</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.....	3.50%	09/15/2053	3,135	2,994,134	0.3
AT&T, Inc., Series B(b)	2.88%	03/02/2025	EUR 1,200	1,477,973	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	USD 1,629	2,531,152	0.3
CK Hutchison Group Telecom Finance SA.....	0.75%	04/17/2026	EUR 1,932	2,407,781	0.2
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025	USD 2,685	2,880,328	0.3
				<u>12,291,368</u>	<u>1.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Dongfeng Motor Hong Kong International Co., Ltd.	1.15%	10/23/2021	EUR 1,203	\$ 1,472,775	0.2%
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	0.90%	11/19/2024	749	931,765	0.1
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	USD 1,271	1,388,672	0.1
				<u>3,793,212</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Las Vegas Sands Corp.	3.20%	08/08/2024	1,025	1,078,158	0.1
Las Vegas Sands Corp.	3.90%	08/08/2029	1,265	1,328,265	0.2
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	905	1,150,223	0.1
				<u>3,556,646</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027	258	299,994	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.	3.13%	06/15/2031	EUR 2,027	2,804,224	0.3
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	5.55%	01/23/2049	USD 1,960	2,569,356	0.3
BAT Netherlands Finance BV	3.13%	04/07/2028	EUR 1,975	2,723,896	0.3
CVS Health Corp.	5.05%	03/25/2048	USD 1,022	1,269,420	0.1
Imperial Brands Finance Netherlands BV	1.75%	03/18/2033	EUR 2,084	2,515,261	0.2
Upjohn Finance BV	1.02%	06/23/2024	701	877,135	0.1
				<u>12,759,292</u>	<u>1.3</u>
ENERGIE					
Boardwalk Pipelines LP.	4.80%	05/03/2029	USD 1,270	1,450,005	0.1
Boardwalk Pipelines LP.	5.95%	06/01/2026	355	422,389	0.0
BP Capital Markets PLC(b)	3.63%	03/22/2029	EUR 1,885	2,462,430	0.2
Cenovus Energy, Inc.	4.40%	04/15/2029	USD 2,043	2,276,585	0.2
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	320	365,249	0.0
Devon Energy Corp.	5.60%	07/15/2041	2,103	2,541,274	0.3
Ecopetrol SA	5.88%	09/18/2023	1	1,080	0.0
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	578	590,623	0.1
Enbridge Energy Partners LP.	7.38%	10/15/2045	1,214	1,849,772	0.2
Energy Transfer LP	6.25%	04/15/2049	2,805	3,515,459	0.4
Eni SpA, Series NC9(b)	2.75%	02/11/2030	EUR 1,305	1,579,308	0.2
Eni SpA, Series NC9(b)	3.38%	07/13/2029	621	793,521	0.1
ONEOK, Inc.	4.55%	07/15/2028	USD 1,504	1,700,001	0.2
ONEOK, Inc.	5.20%	07/15/2048	53	62,149	0.0
ONEOK, Inc.	6.35%	01/15/2031	1,162	1,476,750	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.55%	12/15/2029	164	170,203	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.80%	09/15/2030	511	537,466	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	286	320,497	0.0
Suncor Energy, Inc.	6.50%	06/15/2038	549	754,025	0.1
Suncor Energy, Inc.	6.85%	06/01/2039	447	638,981	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	1,952	2,106,696	0.2
TOTAL SE, Series NC7(b)	1.63%	10/25/2027	EUR 966	1,172,099	0.1
TransCanada PipeLines Ltd.	7.63%	01/15/2039	USD 1,555	2,356,394	0.2
Valero Energy Corp.	6.63%	06/15/2037	326	433,565	0.0
				<u>29,576,521</u>	<u>2.9</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Alibaba Group Holding Ltd.	2.13%	02/09/2031	1,719	1,669,834	0.2
IHS Markit Ltd.	4.25%	05/01/2029	330	376,135	0.0
IHS Markit Ltd.	4.75%	08/01/2028	46	53,634	0.0
				<u>2,099,603</u>	<u>0.2</u>
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.88%	09/29/2023	2,440	2,598,295	0.3
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	3.50%	01/15/2028	39	41,880	0.0
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	3.88%	01/15/2027	31	34,092	0.0
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028	1,533	1,697,264	0.2
Broadcom, Inc.	5.00%	04/15/2030	399	462,108	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	0.63%	12/03/2025	EUR 128	159,302	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	1.00%	12/03/2028	198	247,387	0.0
Fiserv, Inc.	1.13%	07/01/2027	1,044	1,326,811	0.1
Oracle Corp.	3.95%	03/25/2051	USD 1,629	1,698,845	0.2
VeriSign, Inc.	2.70%	06/15/2031	840	841,406	0.1
				<u>9,107,390</u>	<u>0.9</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	1,053	1,225,063	0.1
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Abu Dhabi Ports Co. PJSC	2.50%	05/06/2031	590	586,866	0.1
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	1,785	1,879,605	0.2
ENA Master Trust	4.00%	05/19/2048	221	222,284	0.0
FedEx Corp.	0.45%	05/04/2029	EUR 1,602	1,938,998	0.2
Heathrow Funding Ltd.	6.75%	12/03/2026	GBP 1,326	2,377,114	0.2
				<u>7,004,867</u>	<u>0.7</u>
				<u>101,981,942</u>	<u>10.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	USD 505	\$ 517,720	0.1%
Consortio Transmataro SA	4.70%	04/16/2034	1,395	1,524,037	0.1
E.ON International Finance BV	1.25%	10/19/2027	EUR 1,093	1,416,722	0.1
EDP Finance BV	0.38%	09/16/2026	658	809,698	0.1
Electricite de France SA(b)	2.88%	12/15/2026	1,200	1,497,022	0.1
Enel Finance International NV	2.65%	09/10/2024	USD 1,910	2,009,627	0.2
Iberdrola International BV, Series NC6(b)	1.45%	11/09/2026	EUR 1,600	1,956,322	0.2
SSE PLC	1.38%	09/04/2027	494	641,824	0.1
Western Power Distribution West Midlands PLC	3.88%	10/17/2024	GBP 1,193	1,850,286	0.2
				<u>12,223,258</u>	<u>1.2</u>
ERDGAS					
Talent Yield Investments Ltd.	4.50%	04/25/2022	USD 1,415	1,456,831	0.1
				<u>13,680,089</u>	<u>1.3</u>
				<u>226,485,294</u>	<u>22.4</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Axalta Coating Systems LLC	3.38%	02/15/2029	703	678,527	0.1
INEOS Quattro Finance 2 PLC	2.50%	01/15/2026	EUR 1,417	1,734,907	0.2
INEOS Quattro Finance 2 PLC	3.38%	01/15/2026	USD 222	222,119	0.0
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028	932	921,289	0.1
Solvay SA(b)	2.50%	12/02/2025	EUR 800	1,000,688	0.1
SPCM SA	2.00%	02/01/2026	1,705	2,117,267	0.2
WEPA Hygieneprodukte GmbH	2.88%	12/15/2027	1,240	1,497,160	0.1
				<u>8,171,957</u>	<u>0.8</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC	2.00%	09/01/2028	1,530	1,860,310	0.2
Silgan Holdings, Inc.	2.25%	06/01/2028	896	1,097,282	0.1
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	1,855	2,367,557	0.2
Verallia SA	1.63%	05/14/2028	500	611,248	0.1
				<u>5,936,397</u>	<u>0.6</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Cable One, Inc.	4.00%	11/15/2030	USD 640	634,243	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	276	281,194	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	989	987,616	0.1
Netflix, Inc.	3.63%	05/15/2027	EUR 836	1,169,937	0.1
Netflix, Inc.	4.63%	05/15/2029	793	1,205,153	0.1
				<u>4,278,143</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Lumen Technologies, Inc.	4.50%	01/15/2029	USD 1,250	1,209,178	0.1
T-Mobile USA, Inc.	2.63%	04/15/2026	877	892,784	0.1
T-Mobile USA, Inc.	2.88%	02/15/2031	519	501,050	0.0
T-Mobile USA, Inc.	3.38%	04/15/2029	924	938,774	0.1
Telecom Italia SpA/Milano	1.63%	01/18/2029	EUR 1,515	1,806,635	0.2
				<u>5,348,421</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Allison Transmission, Inc.	3.75%	01/30/2031	USD 1,181	1,134,687	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	EUR 1,233	1,558,334	0.2
Faurecia SE	2.38%	06/15/2029	1,606	1,990,565	0.2
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023	USD 1,489	1,662,583	0.2
Schaeffler AG	2.75%	10/12/2025	EUR 1,700	2,199,046	0.2
ZF Finance GmbH	2.00%	05/06/2027	1,600	1,955,096	0.2
				<u>10,500,311</u>	<u>1.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	1.88%	11/07/2022	430	518,577	0.1
Carnival PLC	1.00%	10/28/2029	1,640	1,641,369	0.1
				<u>2,159,946</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	3.50%	02/15/2029	USD 1,438	1,406,779	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Levi Strauss & Co.	3.50%	03/01/2031	616	606,760	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Avantor Funding, Inc.	2.63%	11/01/2025	EUR 1,617	2,023,712	0.2
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	446	547,380	0.1
Grifols SA	1.63%	02/15/2025	2,055	2,523,104	0.3
IQVIA, Inc.	1.75%	03/15/2026	1,920	2,361,513	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Newell Brands, Inc.	4.70%	04/01/2026	USD 894	\$ 1,004,754	0.1%
Newell Brands, Inc.	4.88%	06/01/2025	212	235,742	0.0
Organon Finance 1 LLC	4.13%	04/30/2028	1,984	2,002,191	0.2
Tenet Healthcare Corp.	4.63%	07/15/2024	1,221	1,237,129	0.1
				<u>11,935,525</u>	<u>1.2</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	EUR 550	689,464	0.1
H&E Equipment Services, Inc.	3.88%	12/15/2028	USD 1,416	1,370,818	0.1
Rexel SA	2.13%	06/15/2025	EUR 218	268,666	0.0
Rexel SA	2.13%	06/15/2028	484	599,784	0.1
				<u>2,928,732</u>	<u>0.3</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Intertrust Group BV	3.38%	11/15/2025	1,660	2,069,025	0.2
Square, Inc.	2.75%	06/01/2026	USD 1,955	1,970,643	0.2
				<u>4,039,668</u>	<u>0.4</u>
TECHNOLOGIE					
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024	573	590,380	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	7.13%	06/15/2024	150	153,237	0.0
				<u>743,617</u>	<u>0.1</u>
				<u>58,056,256</u>	<u>5.8</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(b)	6.50%	03/05/2025	1,800	1,954,438	0.2
Banco Santander SA(b)	6.75%	04/25/2022	EUR 2,200	2,807,441	0.3
Credit Suisse Group AG(b)	7.50%	07/17/2023	USD 1,907	2,056,949	0.2
Discover Financial Services, Series D(b)	6.13%	06/23/2025	1,604	1,799,074	0.2
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	1,306	1,478,414	0.1
Societe Generale SA(b)	7.38%	09/13/2021	2,375	2,413,901	0.2
				<u>12,510,217</u>	<u>1.2</u>
FINANZEN					
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR 1,633	2,016,458	0.2
SLM Corp.	4.20%	10/29/2025	USD 1,152	1,220,939	0.1
				<u>3,237,397</u>	<u>0.3</u>
REITS					
ADLER Group SA	2.75%	11/13/2026	EUR 200	247,563	0.0
ADLER Group SA	3.25%	08/05/2025	1,100	1,393,779	0.2
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/MGP Finance Co-Issuer, Inc.	4.63%	06/15/2025	USD 765	812,338	0.1
				<u>2,453,680</u>	<u>0.3</u>
				<u>18,201,294</u>	<u>1.8</u>
				<u>76,257,550</u>	<u>7.6</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	3.50%	10/01/2049	2,040	2,173,083	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2020	2.50%	05/01/2050	3,758	3,904,100	0.4
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2020	2.50%	07/01/2050	1,716	1,790,490	0.2
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	02/01/2042	270	292,909	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	11/01/2042	3,096	3,348,535	0.4
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	01/01/2043	489	529,465	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2013	3.50%	04/01/2043	1,875	2,029,092	0.2
Federal National Mortgage Association, Series 2018	3.50%	03/01/2048	937	1,002,878	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	11/01/2049	1,325	1,411,221	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2020	2.50%	07/01/2050	5,817	6,102,867	0.6
Federal National Mortgage Association, Series 2020	2.50%	10/01/2050	2,611	2,725,634	0.3
Government National Mortgage Association	3.00%	06/01/2040	12,961	13,523,111	1.3
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2018	4.00%	06/01/2051	4,644	4,962,817	0.5
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2020	2.50%	06/01/2051	4,500	4,659,258	0.4
				<u>48,455,460</u>	<u>4.8</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
CHINA					
China Development Bank, Series 1805	4.88%	02/09/2028	CNY 139,650	23,845,780	2.4
China Development Bank, Series 2015	3.70%	10/20/2030	61,750	9,822,920	1.0
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd.	2.15%	05/13/2025	USD 2,061	2,115,678	0.2
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	1.25%	05/19/2022	EUR 372	458,824	0.0
				<u>36,243,202</u>	<u>3.6</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INDONESIEN						
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	USD 562	\$ 613,423	0.1%
MEXIKO						
	Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	2,304	2,269,440	0.2
	Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	1,040	919,048	0.1
	Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	1,430	1,377,090	0.1
					4,565,578	0.4
SÜDKOREA						
	Korea National Oil Corp.	2.00%	10/24/2021	1,695	1,708,560	0.2
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
	DP World Crescent Ltd.	4.85%	09/26/2028	1,985	2,247,392	0.2
					45,378,155	4.5
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN						
KANADA						
	Canada Housing Trust No. 1	1.80%	12/15/2024	CAD 21,995	18,835,520	1.9
	Canada Housing Trust No. 1	1.95%	12/15/2025	10,375	8,932,751	0.9
	Canada Housing Trust No. 1	2.25%	12/15/2025	4,870	4,246,496	0.4
	Canada Housing Trust No. 1	2.35%	06/15/2027	10,840	9,504,870	0.9
					41,519,637	4.1
FRANKREICH						
	SNCF Reseau	3.13%	10/25/2028	EUR 400	597,048	0.1
					42,116,685	4.2
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE						
FRANKREICH						
	French Republic Government Bond OAT, Series OATE	0.10%	03/01/2026	15,132	20,181,771	2.0
DEUTSCHLAND						
	Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	0.10%	04/15/2026	15,019	20,133,988	2.0
					40,315,759	4.0
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN						
RISIKOTEILUNG – VARIABLE VERZINSLICH						
	Bellemeade Re Ltd.					
	Series 2019-2A, Class M2(c)	3.19%	04/25/2029	USD 1,300	1,320,274	0.1
	Series 2019-3A, Class M1B(c)	1.69%	07/25/2029	649	650,847	0.1
	Series 2019-4A, Class M1B(c)	2.09%	10/25/2029	475	475,000	0.0
	Series 2020-2A, Class M1B(c)	3.29%	08/26/2030	2,208	2,228,065	0.2
	Series 2020-3A, Class M1C(c)	3.79%	10/25/2030	670	693,890	0.1
	Series 2020-4A, Class M2A(c)	2.69%	06/25/2030	450	451,831	0.0
	Connecticut Avenue Securities Trust					
	Series 2019-R03, Class 1M2(c)	2.24%	09/25/2031	812	816,544	0.1
	Series 2019-R04, Class 2M2(c)	2.19%	06/25/2039	476	476,818	0.1
	Series 2019-R06, Class 2M2(c)	2.19%	09/25/2039	435	436,062	0.0
	Series 2020-R01, Class 1M2(c)	2.14%	01/25/2040	939	943,053	0.1
	Federal Home Loan Mortgage Corp.,					
	Series 2021-DNA3, Class M2(c)	2.11%	10/25/2033	1,101	1,118,097	0.1
	Federal Home Loan Mortgage Corp.					
	Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
	Series 2013-DN2, Class M2(c)	4.34%	11/25/2023	468	478,483	0.1
	Series 2014-DN3, Class M3(c)	4.09%	08/25/2024	917	936,900	0.1
	Series 2014-HQ2, Class M3(c)	3.84%	09/25/2024	185	190,132	0.0
	Series 2016-DNA3, Class M3(c)	5.09%	12/25/2028	565	594,802	0.1
	Series 2016-HQA3, Class M3(c)	3.94%	03/25/2029	1,371	1,426,078	0.1
	Series 2017-DNA2, Class M2(c)	3.54%	10/25/2029	1,012	1,054,583	0.1
	Series 2017-DNA3, Class M2(c)	2.59%	03/25/2030	950	970,522	0.1
	Series 2017-HQA2, Class M2(c)	2.74%	12/25/2029	868	885,411	0.1
	Series 2017-HQA3, Class M2(c)	2.44%	04/25/2030	1,742	1,781,610	0.2
	Series 2018-HQA1, Class M2(c)	2.39%	09/25/2030	1,357	1,367,351	0.1
	Series 2019-DNA3, Class M2(c)	2.14%	07/25/2049	159	161,135	0.0
	Series 2019-DNA4, Class M2(c)	2.04%	10/25/2049	171	171,105	0.0
	Series 2019-HQA1, Class M2(c)	2.44%	02/25/2049	526	531,366	0.1
	Series 2020-DNA1, Class M2(c)	1.79%	01/25/2050	214	215,247	0.0
	Series 2020-HQA2, Class M2(c)	3.19%	03/25/2050	592	601,642	0.1
	Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
	Series 2014-C04, Class 1M2(c)	4.99%	11/25/2024	646	667,859	0.1
	Series 2014-C04, Class 2M2(c)	5.09%	11/25/2024	477	490,710	0.1
	Series 2015-C01, Class 1M2(c)	4.39%	02/25/2025	289	296,586	0.0
	Series 2015-C02, Class 1M2(c)	4.09%	05/25/2025	413	422,875	0.0
	Series 2015-C02, Class 2M2(c)	4.09%	05/25/2025	104	105,742	0.0
	Series 2015-C03, Class 1M2(c)	5.09%	07/25/2025	721	741,599	0.1
	Series 2015-C03, Class 2M2(c)	5.09%	07/25/2025	126	128,082	0.0
	Series 2015-C04, Class 1M2(c)	5.79%	04/25/2028	24	25,443	0.0
	Series 2015-C04, Class 2M2(c)	5.64%	04/25/2028	946	997,823	0.1
	Series 2016-C01, Class 2M2(c)	7.04%	08/25/2028	739	785,773	0.1
	Series 2016-C02, Class 1M2(c)	6.09%	09/25/2028	778	820,356	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2016-C06, Class 1M2(c)	4.34%	04/25/2029	USD 435	\$ 453,857	0.0%
Series 2017-C02, Class 2M2(c)	3.74%	09/25/2029	1,557	1,615,545	0.2
Series 2018-C01, Class 1B1(c)	3.64%	07/25/2030	242	247,765	0.0
Series 2018-C01, Class 1M2(c)	2.34%	07/25/2030	1,433	1,445,766	0.1
Home Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1(c)	1.74%	05/25/2029	772	772,438	0.1
Series 2020-1, Class M1B(c)	3.34%	10/25/2030	862	869,978	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-2R, Class A(c)	2.84%	05/27/2023	1,370	1,354,963	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2020-2, Class M1B(c)	4.09%	10/25/2030	1,177	1,183,722	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2019-1, Class M1B(c)	2.04%	02/25/2029	989	992,687	0.1
STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class M2(c)	2.19%	09/25/2048	1,992	2,015,156	0.2
				<u>37,411,573</u>	<u>3.7</u>
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2006-J1, Class 1A11	5.50%	02/25/2036	190	172,311	0.0
Series 2007-15CB, Class A19	5.75%	07/25/2037	236	192,669	0.0
				<u>364,980</u>	<u>0.0</u>
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Deutsche Alt-A Securities Mortgage Loan Trust,					
Series 2006-AR4, Class A2(c)	0.47%	12/25/2036	173	82,547	0.0
				<u>37,859,100</u>	<u>3.7</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - China Bond Portfolio - Class SA			1,631,436	26,267,769	2.6
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 12 Ltd. Series 2021-12A, Class A1 (c)	0.00%	07/20/2034	2,943	2,943,048	0.3
Ballyrock CLO 16 Ltd. Series 2021-16A, Class A1 (c)	0.00%	07/20/2034	1,978	1,978,615	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers Clo 42 Ltd.					
Series 2021-42A, Class A (c)	0.00%	07/16/2035	2,579	2,579,527	0.2
Rockford Tower CLO 2021-1 Ltd. Series 2021-1A, Class A1 (c)	0.00%	07/20/2034	2,678	2,678,085	0.3
Rockford Tower CLO 2021-1 Ltd. Series 2021-1A, Class B (c)	0.00%	07/20/2034	3,159	3,159,162	0.3
				<u>13,338,437</u>	<u>1.3</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Commercial Mortgage Trust, Series 2013-CR6, Class D	4.09%	03/10/2046	1,910	1,786,900	0.2
DBUBS Mortgage Trust, Series 2011-LC2A, Class D	5.39%	07/10/2044	895	894,784	0.1
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2010-C1, Class A2	4.59%	08/10/2043	46	46,137	0.0
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	85	51,666	0.0
Series 2013-G1, Class A2	3.56%	04/10/2031	330	321,720	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2014-C22, Class AS	4.11%	09/15/2047	1,000	1,076,305	0.1
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2012-CBX, Class D	5.07%	06/15/2045	1,050	867,622	0.1
LSTAR Commercial Mortgage Trust, Series 2016-4,					
Class A2	2.58%	03/10/2049	228	231,812	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust,					
Series 2013-C9, Class D	4.11%	05/15/2046	300	271,456	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust, Series 2013-C11,					
Class B	3.71%	03/15/2045	1,758	1,809,777	0.2
				<u>7,358,179</u>	<u>0.7</u>
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
BHMS, Series 2018-ATLS, Class A(c)	1.35%	07/15/2035	1,901	1,900,589	0.2
BX Trust, Series 2018-EXCL, Class A(c)	1.19%	09/15/2037	2,450	2,391,618	0.2
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(c)	1.57%	11/15/2027	752	554,967	0.1
				<u>4,847,174</u>	<u>0.5</u>
				<u>12,205,353</u>	<u>1.2</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
FRANKREICH					
Dexia Credit Local SA	0.50%	01/17/2025	EUR 700	877,678	0.1
DEUTSCHLAND					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	0.00%	06/15/2029	3,170	3,897,084	0.4
INDONESIEN					
Indonesia Government International Bond	1.10%	03/12/2033	752	896,680	0.1
Indonesia Government International Bond	3.38%	07/30/2025	1,511	2,058,287	0.2
				<u>2,954,967</u>	<u>0.3</u>
MEXIKO					
Mexico Government International Bond	4.75%	04/27/2032	USD 2,145	2,437,658	0.2
				<u>10,167,387</u>	<u>1.0</u>

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)		Wert (USD)	Nettover- mögen %
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN								
INDUSTRIE								
GRUNDSTOFFE								
	Klabin Austria GmbH	3.20%	01/12/2031	USD	403	\$	388,843	0.1%
	Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026		279		272,339	0.0
							661,182	0.1
INVESTITIONSGÜTER								
	Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031		1,030		1,030,644	0.1
	Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027		636		675,352	0.0
	Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028		678		771,508	0.1
	Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058		778		7,779	0.0
							2,485,283	0.2
KOMMUNIKATIONSMEDIEN								
	Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030		922		938,308	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER								
	BRF GmbH	4.35%	09/29/2026		735		768,069	0.1
	BRF SA	4.88%	01/24/2030		737		765,697	0.1
							1,533,766	0.2
ENERGIE								
	Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025		589		647,604	0.1
DIENSTLEISTUNGEN								
	MercadoLibre, Inc.	2.38%	01/14/2026		200		199,801	0.0
	MercadoLibre, Inc.	3.13%	01/14/2031		200		194,031	0.0
							393,832	0.0
							6,659,975	0.7
FINANZINSTITUTE								
SONSTIGE FINANZWERTE								
	OEC Finance Ltd.(d)	4.38%	10/25/2029		306		38,502	0.0
	OEC Finance Ltd.(d)	5.25%	12/27/2033		144		16,908	0.0
	OEC Finance Ltd.(d)	7.13%	12/26/2046		192		23,773	0.0
							79,183	0.0
							6,739,158	0.7
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE								
ÄGYPTEN								
	Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031		1,860		1,826,869	0.2
BAHRAIN								
	Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031		1,520		1,525,985	0.2
	Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030		241		270,040	0.0
							1,796,025	0.2
ELFENBEINKÜSTE								
	Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR	295		364,077	0.0
	Ivory Coast Government International Bond	5.88%	10/17/2031		745		987,870	0.1
							1,351,947	0.1
SENEGAL								
	Senegal Government International Bond	6.25%	07/30/2024	USD	1,084		1,205,476	0.1
OMAN								
	Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025		337		352,228	0.0
							6,532,545	0.6
GEMEINDEVERWALTUNG – REGIONALANLEIHEN								
JAPAN								
	Japan Finance Organization for Municipalities, Series G	0.01%	02/02/2028	EUR	696		848,111	0.1
ABS-ANLEIHEN								
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS								
	SoFi Consumer Loan Program Trust, Series 2018-1, Class B	3.65%	02/25/2027	USD	614		623,074	0.1
							1,017,011,388	100.7
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE								
ABS-ANLEIHEN								
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS								
	SBA Tower Trust, Series 2014-2A, Class C	3.87%	10/15/2049		152		161,204	0.0
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN								
CLO – VARIABEL VERZINSLICH								
	Apidos CLO XXXIII Series 2020-33A, Class A (c)	1.88%	07/24/2031		2,244		2,246,496	0.2
	Black Diamond CLO Ltd. Series 2019-2A, Class A1A (c)	1.60%	07/23/2032		460		460,041	0.1
							2,706,537	0.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
STAMMAKTIE					
Mt Logan Re Ltd.(e)			2,300	\$ 2,290,746	0.2%
				5,158,487	0.5
Gesamtanlagen					
(Kosten \$1,003,944,809)				\$ 1,022,169,875	101.2%
Termineinlagen					
Bank of Nova Scotia, Toronto(f)	0.01 %	—		512,571	0.1
BBH, Grand Cayman.(f)	(0.53)%	—		1	0.0
BBH, Grand Cayman.(f)	2.99 %	—		1	0.0
BNP Paribas, Paris(f)	(0.13)%	—		658,988	0.1
BNP Paribas, Paris(f)	0.00 %	—		271	0.0
BNP Paribas, Paris(f)	0.01 %	—		5,353,099	0.5
Citibank, New York(f)	0.01 %	—		10,843,132	1.0
Nordea Bank Abp, Oslo(f)	(0.78)%	—		737,315	0.1
Sumitomo, London(f)	(0.29)%	—		497,497	0.0
Sumitomo, London(f)	0.01 %	—		848,679	0.1
Termineinlagen insgesamt				19,451,554	1.9
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(31,231,156)	(3.1)
Nettovermögen				\$ 1,010,390,273	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Euro-Bund Futures	06/08/2021	21	\$ 4,381,606	\$ 4,351,901	\$ (29,705)
Korea 10 Yr Bond Futures	06/15/2021	104	11,795,642	11,714,803	(80,839)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	198	24,480,625	24,522,609	41,984
Short					
Canadian 10 Yr Bond Futures	09/21/2021	99	11,786,499	11,821,324	(34,825)
Euro-BOBL Futures	06/08/2021	191	31,443,335	31,382,960	60,375
Long Gilt Futures	09/28/2021	38	6,853,132	6,862,300	(9,168)
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2021	233	33,697,625	33,774,078	(76,453)
					\$ (128,631)
				Wertsteigerung	\$ 102,359
				Wertminderung	\$ (230,990)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	AUD	5,826	USD	4,439	06/04/2021	\$ (51,758)
Bank of America, NA.	USD	9,914	GBP	7,122	06/17/2021	192,996
Bank of America, NA.	ZAR	137,463	USD	9,374	06/17/2021	(581,023)
Bank of America, NA.	USD	7,593	CNH	48,948	06/24/2021	91,921
Bank of America, NA.	USD	893	CAD	1,125	07/16/2021	38,730
Bank of America, NA.	USD	9,798	RUB	727,974	07/28/2021	59,041
Barclays Bank PLC	AUD	54,748	USD	41,725	06/04/2021	(480,402)
Barclays Bank PLC	GBP	15,812	USD	21,801	06/17/2021	(638,659)
Barclays Bank PLC	CNH	345,622	USD	52,995	06/24/2021	(1,271,223)
Barclays Bank PLC	IDR	69,144,206	USD	4,674	07/15/2021	(139,048)
Barclays Bank PLC	USD	4,834	IDR	70,066,364	07/15/2021	43,513
BNP Paribas SA.	PLN	8,987	USD	2,299	06/24/2021	(146,063)
BNP Paribas SA.	JPY	7,203,904	USD	66,417	07/16/2021	806,474
BNP Paribas SA.	EUR	9,851	USD	11,779	07/30/2021	(246,869)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	2,854	USD	2,180	06/04/2021	(19,717)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	103,717	USD	5,133	06/18/2021	(64,624)
Brown Brothers Harriman & Co.	CNH	8,887	USD	1,374	06/24/2021	(21,317)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	9,457	USD	11,368	06/30/2021	(170,536)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	1,004,320	USD	9,088	06/30/2021	(57,805)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	9,156	USD	10,919	07/16/2021	(255,868)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	11,487	AUD	14,805	06/30/2021	(72,132)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	64,851	CAD	78,567	06/30/2021	182,544
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	13,080	EUR	10,698	06/30/2021	(27,935)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6,033	GBP	4,265	06/30/2021	19,197
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,177	SGD	2,884	06/30/2021	3,537
Citibank, NA	CNH	34,403	USD	5,282	06/24/2021	(119,420)
Citibank, NA	PLN	17,811	USD	4,532	06/24/2021	(312,674)
Citibank, NA	USD	5,524	CNH	35,532	06/24/2021	54,933

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citibank, NA	COP 14,959,784	USD 3,982	07/15/2021	\$ (41,966)
Citibank, NA	IDR 73,998,117	USD 5,200	07/15/2021	48,580
Citibank, NA	INR 744,720	USD 10,065	07/15/2021	(143,023)
Citibank, NA	THB 72,829	USD 2,340	07/15/2021	9,321
Citibank, NA	USD 4,734	CLP 3,381,732	07/15/2021	(67,697)
Citibank, NA	CAD 54,943	USD 43,892	07/16/2021	(1,586,153)
Citibank, NA	KRW 11,313,670	USD 10,113	07/22/2021	(42,596)
Credit Suisse International	PLN 37,527	USD 10,064	06/24/2021	(144,501)
Credit Suisse International	USD 7,092	PLN 26,808	06/24/2021	200,663
Goldman Sachs Bank USA	USD 4,988	GBP 3,610	06/17/2021	134,627
Goldman Sachs Bank USA	MXN 97,735	USD 4,807	06/18/2021	(90,509)
Goldman Sachs Bank USA	USD 10,025	PLN 37,510	06/24/2021	179,000
Goldman Sachs Bank USA	USD 4,992	INR 377,798	07/15/2021	187,080
HSBC Bank USA	CNH 32,312	USD 4,957	06/24/2021	(116,363)
HSBC Bank USA	EUR 115,591	USD 141,839	08/13/2021	681,841
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 9,693	ZAR 136,692	06/17/2021	206,355
JPMorgan Chase Bank, NA	MXN 14,232	USD 711	06/18/2021	(2,488)
JPMorgan Chase Bank, NA	CNH 91,893	USD 14,234	06/24/2021	(193,973)
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR 8,440,843	USD 571	07/15/2021	(16,434)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 5,056	NOK 42,080	07/15/2021	(24,441)
Morgan Stanley Capital Services LLC	MXN 40,411	USD 1,999	06/18/2021	(25,907)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CLP 10,424,919	USD 14,669	07/15/2021	285,854
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 4,870	CLP 3,576,622	07/15/2021	65,086
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 4,883	INR 370,787	07/15/2021	199,716
Morgan Stanley Capital Services LLC	CHF 4,563	USD 5,013	08/05/2021	(68,367)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY 1,088,436	USD 10,036	08/13/2021	120,766
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY 3,126,451	USD 28,727	08/19/2021	244,816
Morgan Stanley Capital Services LLC	MYR 16,759	USD 4,052	09/23/2021	8,779
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 88,383	USD 104,306	06/18/2021	(3,504,827)
Royal Bank of Scotland PLC	MXN 63,770	USD 3,167	06/18/2021	(29,017)
Royal Bank of Scotland PLC	CNH 3,146	USD 484	06/24/2021	(10,125)
Standard Chartered Bank	KRW 1,304,003	USD 1,170	07/22/2021	(1,050)
Standard Chartered Bank	USD 10,033	KRW 11,308,914	07/22/2021	118,909
UBS AG	USD 4,830	CLP 3,464,163	07/15/2021	(50,249)
				\$ (6,652,480)
			Wertsteigerung	\$ 4,184,279
			Wertminderung	\$ (10,836,759)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	EUR 7,040	09/30/2050	6 Month EURIBOR	(0.017)%	\$ (1,299,290)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	7,040	09/30/2050	0.122%	6 Month EURIBOR	964,135
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	6,680	11/10/2050	6 Month EURIBOR	(0.043)%	(1,297,205)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	6,680	11/10/2050	0.022%	6 Month EURIBOR	1,095,277
Insgesamt					\$ (537,083)
				Wertsteigerung	\$ 2,059,412
				Wertminderung	\$ (2,596,495)

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.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 408	\$ (114,770)	\$ (46,824)	\$ (67,946)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	229	(64,418)	(15,478)	(48,940)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	825	(232,073)	(57,790)	(174,283)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	955	(268,641)	(130,777)	(137,864)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,662	(1,311,421)	(535,508)	(775,913)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,128	(598,606)	(293,477)	(305,129)
Insgesamt				\$ (2,589,929)	\$ (1,079,854)	\$ (1,510,075)
Swaps insgesamt						\$ (2,047,158)

- (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 2021.
- (d) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.
- (f) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	– Australian Dollar
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CLP	– Chilean Peso
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY	– Chinese Yuan Renminbi
COP	– Colombian Peso
EUR	– Euro
GBP	– Great British Pound
IDR	– Indonesian Rupiah
INR	– Indian Rupee
JPY	– Japanese Yen
KRW	– South Korean Won
MXN	– Mexican Peso
MYR	– Malaysian Ringgit
NOK	– Norwegian Krone
PLN	– Polish Zloty
RUB	– Russian Ruble
SGD	– Singapore Dollar
THB	– Thailand Baht
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
CLO	– Collateralized Loan Obligations
CMBS	– Commercial Mortgage-Backed Securities
EURIBOR	– Euro Interbank Offered Rate
LCH	– London Clearing House
OAT	– Obligations Assimilables du Trésor
PIJC	– Public Joint Stock Company

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Cisco Systems, Inc./Delaware	59,104	\$ 3,126,602	0.3%
F5 Networks, Inc.	23,081	4,279,910	0.5
		<u>7,406,512</u>	<u>0.8</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
International Business Machines Corp.	19,323	2,777,488	0.3
PayPal Holdings, Inc.	17,176	4,466,104	0.5
Visa, Inc. - Class A	54,335	12,350,345	1.4
		<u>19,593,937</u>	<u>2.2</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Advanced Micro Devices, Inc.	56,819	4,550,065	0.5
Applied Materials, Inc.	10,704	1,478,543	0.2
Broadcom, Inc.	12,223	5,773,290	0.6
Intel Corp.	78,166	4,464,842	0.5
NVIDIA Corp.	7,759	5,041,643	0.6
NXP Semiconductors NV	28,678	6,063,103	0.7
Texas Instruments, Inc.	35,180	6,677,868	0.7
		<u>34,049,354</u>	<u>3.8</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	12,683	6,399,588	0.7
Microsoft Corp.	130,369	32,550,532	3.6
Oracle Corp.	70,499	5,551,091	0.6
salesforce.com, Inc.	17,145	4,082,225	0.5
		<u>48,583,436</u>	<u>5.4</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	227,153	28,305,535	3.1
		<u>137,938,774</u>	<u>15.3</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of America Corp.	110,357	4,678,033	0.5
Fifth Third Bancorp	265,309	11,180,121	1.3
JPMorgan Chase & Co.	51,436	8,447,849	1.0
PNC Financial Services Group, Inc. (The)	52,402	10,201,622	1.1
Wells Fargo & Co.	64,349	3,006,385	0.3
		<u>37,514,010</u>	<u>4.2</u>
KAPITALMÄRKTE			
Apollo Global Management, Inc.	91,907	5,269,947	0.6
BlackRock, Inc. - Class A	6,027	5,285,920	0.6
Charles Schwab Corp. (The)	124,664	9,206,436	1.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	49,949	18,582,027	2.0
Morgan Stanley	7,927	720,961	0.1
		<u>39,065,291</u>	<u>4.3</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Berkshire Hathaway, Inc. - Class B	74,195	21,475,001	2.4
VERSICHERUNGEN			
Allstate Corp. (The)	10,460	1,428,940	0.1
Aon PLC	11,118	2,816,968	0.3
Arch Capital Group Ltd.	60,929	2,430,458	0.3
		<u>6,676,366</u>	<u>0.7</u>
		<u>104,730,668</u>	<u>11.6</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Howmet Aerospace, Inc.	114,594	4,065,795	0.4
L3Harris Technologies, Inc.	11,762	2,564,822	0.3
Raytheon Technologies Corp.	145,712	12,926,111	1.4
		<u>19,556,728</u>	<u>2.1</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
General Electric Co.	122,072	1,716,332	0.2
Honeywell International, Inc.	105,218	24,295,889	2.7
		<u>26,012,221</u>	<u>2.9</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Jacobs Engineering Group, Inc.	56,604	8,042,296	0.9
KBR, Inc.	87,215	3,553,139	0.4
		<u>11,595,435</u>	<u>1.3</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
STRASSE UND SCHIENE			
Norfolk Southern Corp.	67,994	\$ 19,099,515	2.1%
Union Pacific Corp.	70,437	15,829,307	1.8
		<u>34,928,822</u>	<u>3.9</u>
		<u>92,093,206</u>	<u>10.2</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
AT&T, Inc.	131,243	3,862,481	0.4
Comcast Corp. - Class A	165,847	9,509,667	1.1
		<u>13,372,148</u>	<u>1.5</u>
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	62,325	6,061,106	0.7
Netflix, Inc.	5,827	2,929,874	0.3
Walt Disney Co. (The)	28,065	5,013,812	0.5
		<u>14,004,792</u>	<u>1.5</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	9,999	24,113,189	2.6
Facebook, Inc. - Class A	71,081	23,366,457	2.6
		<u>47,479,646</u>	<u>5.2</u>
MEDIEN			
Discovery, Inc. - Class A (a)	102,520	3,291,917	0.4
Discovery, Inc. - Class C	42,663	1,282,023	0.1
ViacomCBS, Inc. - Class B	101,032	4,285,778	0.5
		<u>8,859,718</u>	<u>1.0</u>
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
T-Mobile US, Inc.	35,410	5,008,745	0.6
		<u>88,725,049</u>	<u>9.8</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	6,687	1,395,109	0.2
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	59,395	6,928,427	0.8
Boston Scientific Corp.	83,242	3,541,947	0.4
Danaher Corp.	28,908	7,404,495	0.8
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	34,521	5,810,920	0.6
		<u>23,685,789</u>	<u>2.6</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Humana, Inc.	12,882	5,638,451	0.6
Quest Diagnostics, Inc.	31,315	4,123,246	0.4
UnitedHealth Group, Inc.	29,828	12,286,750	1.4
		<u>22,048,447</u>	<u>2.4</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
IQVIA Holdings, Inc.	30,303	7,277,568	0.8
PHARMAZEUTIKA			
Eli Lilly & Co.	28,386	5,669,820	0.6
Johnson & Johnson	71,679	12,131,671	1.3
Merck & Co., Inc.	77,262	5,863,413	0.7
Pfizer, Inc.	81,939	3,173,497	0.4
		<u>26,838,401</u>	<u>3.0</u>
		<u>81,245,314</u>	<u>9.0</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
Ford Motor Co.	50,953	740,347	0.1
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Booking Holdings, Inc.	2,010	4,746,715	0.5
McDonald's Corp.	29,030	6,789,827	0.8
		<u>11,536,542</u>	<u>1.3</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Lennar Corp. - Class A	13,142	1,301,190	0.1
Sony Group Corp. (Sponsored ADR)	16,041	1,597,844	0.2
		<u>2,899,034</u>	<u>0.3</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Amazon.com, Inc.	5,444	17,546,393	1.9
eBay, Inc.	48,231	2,936,303	0.3
Etsy, Inc.	4,539	747,710	0.1
		<u>21,230,406</u>	<u>2.3</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Dollar General Corp.	11,241	\$ 2,281,473	0.3%
Target Corp.	19,982	4,534,316	0.5
		<u>6,815,789</u>	<u>0.8</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Advance Auto Parts, Inc.	7,576	1,437,394	0.2
Home Depot, Inc. (The)	25,135	8,015,803	0.9
L Brands, Inc.	56,742	3,964,564	0.4
Lowe's Cos., Inc.	50,692	9,876,322	1.1
Ross Stores, Inc.	32,051	4,050,926	0.4
		<u>27,345,009</u>	<u>3.0</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
PLBY Group, Inc.(a)	71,158	3,242,670	0.4
		<u>73,809,797</u>	<u>8.2</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	69,026	3,816,447	0.4
PepsiCo, Inc.	30,135	4,458,172	0.5
		<u>8,274,619</u>	<u>0.9</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Albertsons Cos., Inc.(a)	171,792	3,296,689	0.4
Costco Wholesale Corp.	8,848	3,346,933	0.4
Kroger Co. (The)	125,017	4,623,129	0.5
Walmart, Inc.	28,248	4,012,063	0.4
		<u>15,278,814</u>	<u>1.7</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
General Mills, Inc.	66,051	4,151,966	0.5
HAUSHALTSPRODUKTE			
Clorox Co. (The)	4,877	861,912	0.1
Procter & Gamble Co. (The)	91,140	12,290,229	1.3
		<u>13,152,141</u>	<u>1.4</u>
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Estee Lauder Cos., Inc. (The) - Class A	15,566	4,771,290	0.5
Honest Co., Inc. (The)	74,670	1,178,293	0.2
		<u>5,949,583</u>	<u>0.7</u>
TABAK			
Philip Morris International, Inc.	18,189	1,753,965	0.2
		<u>48,561,088</u>	<u>5.4</u>
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Chevron Corp.	59,840	6,210,793	0.7
EOG Resources, Inc.	82,964	6,665,328	0.7
Exxon Mobil Corp.	134,970	7,878,199	0.9
Pioneer Natural Resources Co.	32,221	4,903,714	0.5
		<u>25,658,034</u>	<u>2.8</u>
DIVERSIFIZIERT			
ERWERBSGESELLSCHAFT FÜR BESONDERE ZWECKE			
HealthCor Catalio Acquisition Corp.	373,061	3,678,382	0.4
Landcadia Holdings IV, Inc.	646,882	6,423,538	0.7
		<u>10,101,920</u>	<u>1.1</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
NextEra Energy, Inc.	65,101	4,766,695	0.5
GRUNDSTOFFE			
CONTAINER UND VERPACKUNGEN			
Berry Global Group, Inc.	35,656	2,432,096	0.3
		<u>670,062,641</u>	<u>74.2</u>
OPTIONSSCHEINE			
FINANZWERTE			
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Pershing Square Tontine Holdings Ltd., expiring 07/24/2027.	6,105	58,242	0.0
		<u>670,120,883</u>	<u>74.2</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
GELDMARKTINSTRUMENTE					
US-SCHATZWECHSEL					
U.S. Treasury Bill	0.00%	07/27/2021	USD 35,900,000	\$ 35,899,164	4.0%
U.S. Treasury Bill(b)	0.00%	07/15/2021	35,800,000	35,799,563	4.0
U.S. Treasury Bill	0.00%	08/12/2021	35,000,000	34,998,950	3.9
U.S. Treasury Bill(b)	0.00%	08/05/2021	33,400,000	33,398,794	3.7
U.S. Treasury Bill	0.00%	07/20/2021	24,900,000	24,899,661	2.7
U.S. Treasury Bill	0.00%	07/06/2021	2,100,000	2,099,980	0.2
				<u>167,096,112</u>	<u>18.5</u>
				<u>837,216,995</u>	<u>92.7</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
KOMMUNIKATIONS-DIENSTLEISTUNGEN					
UNTERHALTUNG					
Epic Games, Inc.(c)			10,735	<u>9,500,475</u>	<u>1.0</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
Stripe, Inc.(c)			15,855	<u>636,182</u>	<u>0.1</u>
				<u>10,136,657</u>	<u>1.1</u>
VORZUGSAKTIE					
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Dream Holdings, Inc., Series 2(c)	0.00%		92,100	<u>947,709</u>	<u>0.1</u>
TABAK					
Dream Holdings, Inc., Series D(c)	0.00%		326,648	<u>2,330,633</u>	<u>0.2</u>
				<u>3,278,342</u>	<u>0.3</u>
				<u>13,414,999</u>	<u>1.4</u>
Gesamtanlagen				<u>\$ 850,631,994</u>	<u>94.1%</u>
Termineinlagen					
(Kosten \$751,484,250)					
Credit Suisse AG, Zurich(d)	(1.44)%	—		82,727	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(d)	(0.78)%	—		1,916,978	0.2
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(d)	(0.00)%	—		300,315	0.1
SEB, Stockholm(d)	0.01 %	—		76,716,149	8.5
Sumitomo, Tokyo(d)	(0.29)%	—		37,245	0.0
Sumitomo, Tokyo(d)	0.01 %	—		234,737	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>79,288,151</u>	<u>8.8</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(26,160,048)</u>	<u>(2.9)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 903,760,097</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Short					
S&P 500 E-Mini Futures	06/18/2021	123	\$ 24,290,523	\$ 25,845,376	<u>\$ (1,554,853)</u>

DEWISE-TERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 13	AUD 16	06/30/2021	\$ (79)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,109	CHF 2,786	06/30/2021	(9,395)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 451,580	EUR 369,349	06/30/2021	(933,579)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 8,918	GBP 6,304	06/30/2021	28,375
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 87,861	JPY 9,568,882	06/30/2021	(721,454)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 101	PLN 371	06/30/2021	96
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,077	SGD 2,752	06/30/2021	3,376
				<u>\$ (1,632,660)</u>
			Wertsteigerung	\$ 31,847
			Wertminderung	\$ (1,664,507)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhalterner Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Goldman Sachs International					
AppLovin Corp.	48	LIBOR minus 9.352%	USD 3	03/06/2023	\$ (523)
AppLovin Corp.	279	LIBOR minus 8.947%	16	03/06/2023	(3,041)
AppLovin Corp.	168	LIBOR minus 5.794%	10	03/06/2023	(1,831)
AppLovin Corp.	273	LIBOR minus 5.193%	19	03/06/2023	(2,975)
AppLovin Corp.	172	LIBOR minus 4.941%	11	03/06/2023	(1,875)
AppLovin Corp.	10,110	LIBOR minus 4.121%	639	03/06/2023	(110,192)
AppLovin Corp.	528	LIBOR minus 4.120%	34	03/06/2023	(5,755)
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Acadia Realty Trust	535	FedFundEffective minus 0.26%	11	03/06/2023	(4,028)
Acadia Realty Trust	4,553	FedFundEffective minus 0.25%	62	03/06/2023	(34,279)
Acadia Realty Trust	1,300	FedFundEffective minus 0.24%	17	03/06/2023	(9,787)
Acadia Realty Trust	130	FedFundEffective minus 0.23%	2	03/06/2023	(979)
Agree Realty Corp.	96	FedFundEffective minus 0.26%	6	03/06/2023	(580)
Agree Realty Corp.	855	FedFundEffective minus 0.25%	55	03/06/2023	(5,168)
Agree Realty Corp.	251	FedFundEffective minus 0.24%	16	03/06/2023	(1,517)
Agree Realty Corp.	25	FedFundEffective minus 0.23%	2	03/06/2023	(151)
Chatham Lodging Trust	2,008	FedFundEffective minus 0.24%	17	03/06/2023	(9,954)
Chatham Lodging Trust	199	FedFundEffective minus 0.23%	1	03/06/2023	(986)
Chatham Lodging Trust	812	FedFundEffective minus 0.26%	11	03/06/2023	(4,025)
Chatham Lodging Trust	7,056	FedFundEffective minus 0.25%	56	03/06/2023	(34,979)
Global Payments, Inc.	34	FedFundEffective minus 0.26%	7	03/06/2023	(1,075)
Global Payments, Inc.	248	FedFundEffective minus 0.25%	40	03/06/2023	(7,840)
Global Payments, Inc.	79	FedFundEffective minus 0.24%	15	03/06/2023	(2,497)
Global Payments, Inc.	7	FedFundEffective minus 0.23%	1	03/06/2023	(221)
HSBC Holdings PLC	400	HIBOR minus 0.75%	HKD 15	03/06/2023	(448)
HSBC Holdings PLC	1,600	HIBOR minus 0.40%	67	03/06/2023	(1,790)
HSBC Holdings PLC	400	HIBOR minus 1.50%	16	03/06/2023	(448)
HSBC Holdings PLC	4,267	HIBOR minus 1.375%	169	03/06/2023	(4,774)
HSBC Holdings PLC	2,400	HIBOR minus 1.00%	88	03/06/2023	(2,685)
Laboratory Corp. of America Holdings	37	FedFundEffective minus 0.26%	USD 9	03/06/2023	(3,947)
Laboratory Corp. of America Holdings	280	FedFundEffective minus 0.25%	47	03/06/2023	(29,868)
Laboratory Corp. of America Holdings	89	FedFundEffective minus 0.24%	17	03/06/2023	(9,494)
Laboratory Corp. of America Holdings	8	FedFundEffective minus 0.23%	2	03/06/2023	(853)
Oxford Industries, Inc.	70	FedFundEffective minus 0.26%	6	03/06/2023	(2,947)
Oxford Industries, Inc.	526	FedFundEffective minus 0.25%	25	03/06/2023	(22,146)
Oxford Industries, Inc.	156	FedFundEffective minus 0.24%	8	03/06/2023	(6,568)
Oxford Industries, Inc.	15	FedFundEffective minus 0.23%	1	03/06/2023	(632)
Palantir Technologies, Inc.	990	FedFundEffective minus 0.25%	21	03/06/2023	(3,939)
Palantir Technologies, Inc.	17,689	FedFundEffective minus 0.24%	333	03/06/2023	(70,373)
Regency Centers Corp.	185	FedFundEffective minus 0.26%	11	03/06/2023	(3,630)
Regency Centers Corp.	1,519	FedFundEffective minus 0.25%	67	03/06/2023	(29,808)
Regency Centers Corp.	431	FedFundEffective minus 0.24%	19	03/06/2023	(8,458)
Regency Centers Corp.	43	FedFundEffective minus 0.23%	2	03/06/2023	(844)
Snap-on, Inc.	30	FedFundEffective minus 0.26%	6	03/06/2023	(3,376)
Snap-on, Inc.	229	FedFundEffective minus 0.25%	32	03/06/2023	(25,768)
Snap-on, Inc.	73	FedFundEffective minus 0.24%	11	03/06/2023	(8,214)
Snap-on, Inc.	6	FedFundEffective minus 0.23%	1	03/06/2023	(675)
Stryker Corp.	30	FedFundEffective minus 0.26%	7	03/06/2023	(1,900)
Stryker Corp.	228	FedFundEffective minus 0.25%	44	03/06/2023	(14,439)
Stryker Corp.	73	FedFundEffective minus 0.24%	16	03/06/2023	(4,623)
Stryker Corp.	7	FedFundEffective minus 0.23%	1	03/06/2023	(443)
Washington Prime Group, Inc.	6	LIBOR minus 9.58%	0**	03/06/2023	33
Washington Prime Group, Inc.	13	LIBOR minus 8.83%	0**	03/06/2023	72
Washington Prime Group, Inc.	119	LIBOR minus 8.38%	1	03/06/2023	661
Washington Prime Group, Inc.	20	LIBOR minus 8.28%	0**	03/06/2023	111
Washington Prime Group, Inc.	325	LIBOR minus 7.74%	2	03/06/2023	1,806
Washington Prime Group, Inc.	2,824	LIBOR minus 7.10%	20	03/06/2023	15,689
Washington Prime Group, Inc.	368	LIBOR minus 6.44%	3	03/06/2023	2,044
Washington Prime Group, Inc.	91	FedFundEffective minus 7.88%	1	03/06/2023	506
Washington Prime Group, Inc.	26	FedFundEffective minus 3.63%	0**	03/06/2023	144
Washington Prime Group, Inc.	15	FedFundEffective minus 3.38%	0**	03/06/2023	83
Washington Prime Group, Inc.	56	FedFundEffective minus 3.08%	0**	03/06/2023	311
Washington Prime Group, Inc.	15	FedFundEffective minus 3.03%	0**	03/06/2023	83
Washington Prime Group, Inc.	8	FedFundEffective minus 2.73%	0**	03/06/2023	44
Washington Prime Group, Inc.	178	FedFundEffective minus 2.48%	0**	03/06/2023	989
Washington Prime Group, Inc.	117	FedFundEffective minus 2.43%	0**	03/06/2023	650
Washington Prime Group, Inc.	78	FedFundEffective minus 13.62%	0**	03/06/2023	433
Washington Prime Group, Inc.	31	FedFundEffective minus 12.57%	0**	03/06/2023	172
Washington Prime Group, Inc.	164	FedFundEffective minus 12.56%	0**	03/06/2023	911
Washington Prime Group, Inc.	62	LIBOR minus 39.13%	0**	03/06/2023	344

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Washington Prime Group, Inc.	101	LIBOR minus 33.83%	USD 1	03/06/2023	\$ 561
Washington Prime Group, Inc.	50	LIBOR minus 29.88%	0**	03/06/2023	278
Washington Prime Group, Inc.	91	LIBOR minus 28.88%	1	03/06/2023	506
Washington Prime Group, Inc.	109	LIBOR minus 28.48%	1	03/06/2023	606
Washington Prime Group, Inc.	53	LIBOR minus 21.83%	0**	03/06/2023	294
Washington Prime Group, Inc.	52	LIBOR minus 15.18%	0**	03/06/2023	289
Washington Prime Group, Inc.	97	LIBOR minus 12.41%	1	03/06/2023	539
Washington Prime Group, Inc.	89	FedFundEffective minus 8.33%	1	03/06/2023	494
Washington Prime Group, Inc.	48	FedFundEffective minus 8.13%	0**	03/06/2023	267
Washington Prime Group, Inc.	53	FedFundEffective minus 8.03%	1	03/06/2023	294
Washington Prime Group, Inc.	33	FedFundEffective minus 11.43%	0**	03/06/2023	183
Washington Prime Group, Inc.	80	FedFundEffective minus 11.37%	0**	03/06/2023	444
Washington Prime Group, Inc.	49	FedFundEffective minus 10.17%	0**	03/06/2023	272
Insgesamt					\$ (477,235)
				Wertsteigerung	\$ 30,113
				Wertminderung	\$ (507,348)
Swaps insgesamt					\$ (477,235)

** Nomineller Betrag geringer als \$500.

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Kontrakte/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
SCHATZOBBLIGATIONEN					
Bonos de la Tesoreria de la Republica en pesos	2.80%	10/01/2033	CLP 905,000	\$ 1,042,181	0.4%
China Government Bond, Series INBK	3.39%	03/16/2050	CNY 32,040	4,789,081	1.9
China Government Bond, Series INBK	3.81%	09/14/2050	35,000	5,673,429	2.2
Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP 16,122,300	4,176,624	1.6
Colombian TES, Series B	6.25%	11/26/2025	41,112,600	11,406,418	4.4
Colombian TES, Series B	6.25%	07/09/2036	17,393,700	3,976,956	1.5
Colombian TES, Series B	7.00%	06/30/2032	1,777,900	458,274	0.2
Colombian TES, Series B	7.50%	08/26/2026	4,424,000	1,275,551	0.5
Colombian TES, Series B	7.75%	09/18/2030	5,771,600	1,609,106	0.6
Colombian TES, Series B	10.00%	07/24/2024	15,461,500	4,805,616	1.9
Hungary Government Bond, Series 26/E	1.50%	04/22/2026	HUF 2,415,580	8,252,299	3.2
India Government Bond	7.72%	05/25/2025	INR 191,000	2,851,723	1.1
Indonesia Treasury Bond, Series FR68	8.38%	03/15/2034	IDR 81,562,000	6,323,410	2.4
Indonesia Treasury Bond, Series FR81	6.50%	06/15/2025	59,665,000	4,335,476	1.7
Indonesia Treasury Bond, Series FR82	7.00%	09/15/2030	39,565,000	2,870,782	1.1
Malaysia Government Bond, Series 0319	3.48%	06/14/2024	MYR 21,740	5,436,446	2.1
Malaysia Government Bond, Series 0413	3.84%	04/15/2033	10,138	2,456,744	0.9
Mexican Bonos, Series M	7.75%	05/29/2031	MXN 68,364	3,697,201	1.4
Mexican Bonos, Series M	8.00%	09/05/2024	220,975	11,825,768	4.6
Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047	86,783	4,538,102	1.8
Peru Government Bond	6.90%	08/12/2037	PEN 18,905	5,443,976	2.1
Peru Government Bond	6.95%	08/12/2031	6,371	1,953,590	0.8
Peru Government Bond	8.20%	08/12/2026	6,603	2,176,595	0.8
Republic of Poland Government Bond, Series 1024	2.25%	10/25/2024	PLN 25,869	7,405,929	2.9
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6207	8.15%	02/03/2027	RUB 108,069	1,580,210	0.6
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212	7.05%	01/19/2028	962,787	13,337,795	5.2
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6228	7.65%	04/10/2030	438,438	6,262,801	2.4
Thailand Government Bond	1.60%	12/17/2029	THB 99,535	3,157,882	1.2
Thailand Government Bond	3.78%	06/25/2032	307,123	11,588,985	4.5
				<u>144,708,950</u>	<u>56.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE					
Brazil Letras do Tesouro Nacional, Series LTN	0.00%	01/01/2024	BRL 69,290	10,973,016	4.2
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2023	56,982	11,431,113	4.4
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2025	39,964	8,134,804	3.2
Egypt Government Bond, Series 3YR	14.31%	10/13/2023	EGP 74,000	4,724,399	1.8
Egypt Government Bond, Series 10Y	14.40%	09/10/2029	76,050	4,706,540	1.8
Republic of South Africa Government Bond, Series 2030	8.00%	01/31/2030	ZAR 83,386	5,716,724	2.2
Republic of South Africa Government Bond, Series 2032	8.25%	03/31/2032	129,227	8,490,595	3.3
Republic of South Africa Government Bond, Series 2037	8.50%	01/31/2037	112,032	6,893,100	2.7
Republic of South Africa Government Bond, Series R214	6.50%	02/28/2041	133,316	6,401,645	2.5
				<u>67,471,936</u>	<u>26.1</u>
QUASI-STAAITSANLEIHEN					
Eskom Holdings SOC Ltd., Series 42	8.50%	04/25/2042	106,000	5,689,388	2.2
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
Empresas Publicas de Medellin ESP	8.38%	11/08/2027	COP 5,810,000	1,542,400	0.6
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR 40,000	563,895	0.2
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	50,000	686,752	0.3
				<u>2,793,047</u>	<u>1.1</u>
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN					
International Bank for Reconstruction & Development	7.45%	08/20/2021	IDR 37,000,000	2,593,471	1.0
INFLATIONSGBUNDENE WERTPAPIERE					
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP 3,492,680	816,853	0.3
STAAITSANLEIHEN					
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	01/09/2038	USD 1,680	662,340	0.3
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	88	34,184	0.0
				<u>696,524</u>	<u>0.3</u>
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN					
OPTIONEN AUF TERMINKONTRAKTE					
CAD/USD					
Expiration: Jul 2021, Exercise Price: USD 1.31(a)			28,253,250	3,859	0.0
SWAPTIONS					
IRS Swaption, Deutsche Bank AG					
Expiration: Sep 2021, Exercise Rate:	2.00%		12,588,000	63,319	0.0
				<u>67,178</u>	<u>0.0</u>
				<u>224,837,347</u>	<u>87.0</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
SCHATZOBBLIGATIONEN					
Russian Federal Bond - OFZ					
Series 6226	7.95%	10/07/2026	RUB 438,163	6,333,316	2.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
STAATLICHE BEHÖRDEN					
National Highways Authority of India.	7.30%	05/18/2022	INR 20,000	\$ 277,513	0.1%
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
Digicel Group Holdings Ltd.(b) (c)	7.00%	06/14/2021	USD 49	36,976	0.0
Digicel Group Holdings Ltd.(c)	8.00%	04/01/2025	125	105,067	0.1
				142,043	0.1
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE					
Fideicomiso PA Costera	6.25%	01/15/2034	COP 500,000	139,846	0.1
				6,892,718	2.7
Gesamtanlagen					
(Kosten \$241,954,449)				\$ 231,730,065	89.7%
Termineinlagen					
ANZ, London(d)	(0.13)%	—		287	0.0
Royal Bank of Canada, Toronto(d)	0.01 %	—		91	0.0
Sumitomo, Tokyo(d)	0.01 %	—		14,170,863	5.5
Termineinlagen insgesamt				14,171,241	5.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				12,442,655	4.8
Nettovermögen				\$ 258,343,961	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2021	37	\$ 5,351,125	\$ 5,363,265	\$ (12,140)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	65	8,577,133	8,575,938	1,195
					\$ (10,945)
				Wertsteigerung	\$ 1,195
				Wertminderung	\$ (12,140)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	BRL 13,210	USD 2,526	06/02/2021	\$ (8,386)
Bank of America, NA.	USD 5,094	BRL 26,849	06/02/2021	57,415
Bank of America, NA.	ZAR 366,714	USD 25,043	06/17/2021	(1,513,876)
Bank of America, NA.	HUF 1,867,915	USD 6,223	06/24/2021	(316,286)
Bank of America, NA.	PLN 14,179	USD 3,713	06/24/2021	(144,197)
Bank of America, NA.	RUB 16,970	USD 228	07/28/2021	(1,376)
Barclays Bank PLC	AUD 4,055	USD 3,091	06/04/2021	(35,425)
Barclays Bank PLC	USD 24,593	CNH 160,387	06/24/2021	589,917
Barclays Bank PLC	INR 189,439	USD 2,582	07/15/2021	(14,656)
Barclays Bank PLC	USD 6,244	IDR 92,028,749	07/15/2021	162,697
Barclays Bank PLC	USD 4,874	INR 372,539	07/15/2021	232,611
Barclays Bank PLC	USD 2,580	KRW 2,879,562	07/22/2021	4,656
Barclays Bank PLC	USD 1,441	MYR 5,964	09/23/2021	(2,462)
BNP Paribas SA.	USD 4,069	ZAR 57,607	06/17/2021	103,094
BNP Paribas SA.	USD 2,632	MXN 52,617	06/18/2021	4,251
BNP Paribas SA.	CNH 45,784	USD 7,001	06/24/2021	(187,953)
BNP Paribas SA.	CZK 81,421	USD 3,724	06/24/2021	(175,156)
BNP Paribas SA.	PLN 11,146	USD 2,871	06/24/2021	(161,051)
BNP Paribas SA.	USD 4,346	CZK 94,105	06/24/2021	161,430
BNP Paribas SA.	USD 6,530	PLN 24,412	06/24/2021	110,519
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 313	ZAR 4,505	06/17/2021	13,459
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN 29,923	USD 1,481	06/18/2021	(18,042)
Brown Brothers Harriman & Co.	CNH 1,000	USD 154	06/24/2021	(3,276)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 11,297	CZK 249,144	06/24/2021	635,369
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 2,066	HUF 637,610	06/24/2021	165,779
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 5,864	PLN 22,784	06/24/2021	334,448
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 10,919	THB 339,549	07/15/2021	(55,030)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 12	CZK 250	06/21/2021	(12)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 146	PLN 539	06/21/2021	1,044
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 6	SGD 7	06/21/2021	44
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 50	EUR 41	06/30/2021	(106)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 6	SGD 8	06/30/2021	10
Citibank, NA.	HUF 1,521,543	USD 4,924	06/24/2021	(402,782)
Citibank, NA.	USD 5,113	HUF 1,558,329	06/24/2021	342,521
Citibank, NA.	COP 73,114,263	USD 19,462	07/15/2021	(205,104)
Citibank, NA.	PEN 27,585	USD 7,547	07/15/2021	291,935

AB SICAV I
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Credit Suisse International	CZK	35,027	USD	1,582	06/24/2021	\$ (95,119)
Credit Suisse International	PLN	24,727	USD	6,629	06/24/2021	(97,864)
Credit Suisse International	USD	6,150	HUF	1,815,273	06/24/2021	205,300
Deutsche Bank AG	USD	7,720	PLN	28,812	06/24/2021	117,542
Deutsche Bank AG	INR	324,403	USD	4,359	07/15/2021	(87,640)
Goldman Sachs Bank USA	BRL	20,595	USD	3,895	06/02/2021	(57,048)
Goldman Sachs Bank USA	MXN	107,643	USD	5,387	06/18/2021	(6,966)
Goldman Sachs Bank USA	USD	27,885	MXN	560,731	06/18/2021	213,575
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,263	BRL	6,725	07/02/2021	24,131
HSBC Bank USA	USD	5,467	ZAR	80,199	06/17/2021	340,451
HSBC Bank USA	USD	6,342	PLN	23,873	06/24/2021	152,006
HSBC Bank USA	USD	15,551	EUR	12,677	08/03/2021	(73,220)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	2,717	CZK	57,134	06/24/2021	19,313
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR	8,874,742	USD	601	07/15/2021	(17,279)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	3,100	AUD	4,056	06/04/2021	26,181
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	5,607	ZAR	82,278	06/17/2021	350,998
Morgan Stanley Capital Services LLC	MXN	47,841	USD	2,369	06/18/2021	(27,900)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CLP	1,806,586	USD	2,554	07/15/2021	61,433
Morgan Stanley Capital Services LLC	INR	187,705	USD	2,547	07/15/2021	(26,415)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	7,581	CLP	5,387,250	07/15/2021	(147,720)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY	1,104,241	USD	10,147	08/19/2021	87,157
Royal Bank of Scotland PLC	BRL	1,773	USD	327	06/02/2021	(12,974)
Royal Bank of Scotland PLC	CNH	16,122	USD	2,501	06/24/2021	(29,927)
Standard Chartered Bank	USD	1,608	BRL	8,729	06/02/2021	66,653
Standard Chartered Bank	USD	1,414	IDR	20,959,432	07/15/2021	45,494
Standard Chartered Bank	USD	7,484	KRW	8,344,400	07/22/2021	6,718
UBS AG	MXN	105,237	USD	5,241	06/18/2021	(32,281)
UBS AG	USD	2,587	CZK	55,568	06/24/2021	74,452
UBS AG	USD	2,208	RUB	164,350	07/28/2021	17,905
						\$ 1,062,979
					Wertsteigerung	\$ 5,020,508
					Wertminderung	\$ (3,957,529)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

VERKAUFTE WÄHRUNGSOPTIONEN

Bezeichnung	Ausübungs- preis		Fälligkeit	Kontrakte (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Bank of America, NA -Put - CAD vs. USD (c)	CAD	1.36	Jul 2021	CAD 29,444	\$ 66,704	\$ (609)

VERKAUFTE ZINS-SWAPTIONEN

Bezeichnung	Ausübungs- preis		Fälligkeit	Kontrakte (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Deutsche Bank AG London, Put - OTC - 1 Year Interest Rate Swap	2.25%		Sep 2021	USD 12,588,000	\$ 121,617	\$ (31,119)

ZENTRAL ABGERECHNETE INFLATIONSSWAPS (CPI)

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 24,170	03/23/2026	CPI#	2.471%	\$ (383,233)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	5,250	05/21/2031	CPI#	2.645%	42,657
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	1,860	02/22/2051	CPI#	2.348%	(82,326)
Insgesamt					\$ (422,902)
				Wertsteigerung	\$ 42,657
				Wertminderung	\$ (465,559)

Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 26,150	03/23/2026	0.976%	3 Month LIBOR	\$ (151,255)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	5,710	05/21/2031	1.645%	3 Month LIBOR	(31,855)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	4,100	03/23/2031	1.730%	3 Month LIBOR	(69,577)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	2,950	02/22/2051	1.854%	3 Month LIBOR	103,898

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 12,900	03/23/2024	3 Month LIBOR	0.439%	\$ 19,219
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	MXN 1,248,440	12/12/2022	4 Week TIIE	4.390%	(567,502)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	415,015	02/27/2023	4 Week TIIE	4.800%	(153,462)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	160,865	03/23/2023	4 Week TIIE	5.640%	2,207
Insgesamt					<u>\$ (848,327)</u>
				Wertsteigerung	\$ 125,324
				Wertminderung	\$ (973,651)
Swaps insgesamt					<u><u>\$ (1,271,229)</u></u>

- (a) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.
- (b) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (c) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (d) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
 BRL – Brazilian Real
 CAD – Canadian Dollar
 CLP – Chilean Peso
 CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
 CNY – Chinese Yuan Renminbi
 COP – Colombian Peso
 CZK – Czech Koruna
 EGP – Egyptian Pound
 EUR – Euro
 HUF – Hungarian Forint
 IDR – Indonesian Rupiah
 INR – Indian Rupee
 JPY – Japanese Yen
 KRW – South Korean Won
 MXN – Mexican Peso
 MYR – Malaysian Ringgit
 PEN – Peruvian Sol
 PLN – Polish Zloty
 RUB – Russian Ruble
 SGD – Singapore Dollar
 THB – Thailand Baht
 USD – United States Dollar
 ZAR – South African Rand

Glossar:

CBT – Chicago Board of Trade
 CME – Chicago Mercantile Exchange
 CPI – Consumer Price Index
 IRS – Interest Rate Swaption
 LCH – London Clearing House
 LIBOR – London Interbank Offered Rate
 TIIE – Banco de México Equilibrium Interbank Interest Rate

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE						
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
CHINA						
	China Government Bond, Series INBK	3.39%	03/16/2050	CNY 4,430	\$ 662,161	1.2%
INDIEN						
	India Government Bond.	5.15%	11/09/2025	INR 196,520	2,686,153	4.9
	India Government Bond.	6.19%	09/16/2034	31,300	415,298	0.8
	India Government Bond.	7.17%	01/08/2028	181,730	2,645,487	4.8
	India Government Bond.	7.72%	05/25/2025	161,140	2,405,898	4.4
					8,152,836	14.9
INDONESIEN						
	Indonesia Treasury Bond, Series FR56	8.38%	09/15/2026	IDR 34,127,000	2,684,052	4.9
	Indonesia Treasury Bond, Series FR73	8.75%	05/15/2031	21,700,000	1,759,849	3.2
	Indonesia Treasury Bond, Series FR77	8.13%	05/15/2024	20,829,000	1,582,042	2.9
	Indonesia Treasury Bond, Series FR81	6.50%	06/15/2025	34,910,000	2,536,687	4.7
	Indonesia Treasury Bond, Series FR82	7.00%	09/15/2030	14,496,000	1,051,810	1.9
					9,614,440	17.6
MALAYSIA						
	Malaysia Government Bond, Series 0114	4.18%	07/15/2024	MYR 2,670	681,146	1.3
	Malaysia Government Bond, Series 0316	3.90%	11/30/2026	10,470	2,694,245	4.9
	Malaysia Government Bond, Series 0413	3.84%	04/15/2033	3,200	775,457	1.4
					4,150,848	7.6
PHILIPPINEN						
	Philippine Government International Bond	6.25%	01/14/2036	PHP 18,000	447,548	0.8
SINGAPUR						
	Singapore Government Bond.	2.75%	03/01/2046	SGD 610	538,022	1.0
	Singapore Government Bond.	2.88%	09/01/2030	2,488	2,103,089	3.9
					2,641,111	4.9
SÜDKOREA						
	Korea Treasury Bond, Series 2503	1.50%	03/10/2025	KRW 2,018,800	1,810,894	3.3
	Korea Treasury Bond, Series 2912	1.38%	12/10/2029	972,000	822,093	1.5
	Korea Treasury Bond, Series 3909	1.13%	09/10/2039	1,451,420	1,078,373	2.0
	Korea Treasury Bond, Series 4903	2.00%	03/10/2049	1,367,680	1,155,990	2.1
					4,867,350	8.9
THAILAND						
	Thailand Government Bond.	1.45%	12/17/2024	THB 27,048	881,455	1.6
	Thailand Government Bond.	1.59%	12/17/2035	73,643	2,182,114	4.0
	Thailand Government Bond.	3.30%	06/17/2038	23,600	843,817	1.5
	Thailand Government Bond.	3.78%	06/25/2032	30,000	1,132,021	2.1
					5,039,407	9.2
					35,575,701	65.1
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE						
QUASI-STAAATSANLEIHEN						
CHINA						
	China Development Bank, Series 1904	3.68%	02/26/2026	CNY 20,000	3,192,523	5.8
	China Development Bank, Series 1905	3.48%	01/08/2029	19,360	3,040,497	5.6
	China Development Bank, Series 2004	3.43%	01/14/2027	20,000	3,150,797	5.8
					9,383,817	17.2
INDIEN						
	Export-Import Bank of India, Series P-06	9.10%	06/15/2022	INR 50,000	692,791	1.2
					10,076,608	18.4
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN						
CHINA						
	Agricultural Development Bank of China, Series 2008	3.45%	09/23/2025	CNY 10,000	1,581,543	2.9
VIETNAM						
	Viet Nam Debt & Asset Trading Corp.	1.00%	10/10/2025	USD 400	356,075	0.7
					1,937,618	3.6
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN						
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS						
	AB SICAV I - China Bond Portfolio - Class SA			118,569	1,909,088	3.5
SUPRANATIONALE UNTERNEHMEN						
	European Bank for Reconstruction & Development, Series G	5.00%	01/15/2026	INR 60,000	802,353	1.5
	European Bank for Reconstruction & Development, Series G	5.15%	02/16/2024	60,000	831,846	1.5
					1,634,199	3.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
FINANZINSTITUTE					
REITS					
Easy Tactic Ltd.	8.13%	02/27/2023	USD 200	\$ 195,225	0.3%
Fantasia Holdings Group Co., Ltd.	9.88%	10/19/2023	200	183,291	0.3
Kaisa Group Holdings Ltd.	11.70%	11/11/2025	200	201,305	0.4
Sunac China Holdings Ltd.	6.65%	08/03/2024	200	207,366	0.4
Zhenro Properties Group Ltd.	8.35%	03/10/2024	200	207,168	0.4
				<u>994,355</u>	<u>1.8</u>
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
TML Holdings Pte Ltd.	5.50%	06/03/2024	200	207,500	0.4
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	177	201,646	0.4
				<u>1,403,501</u>	<u>2.6</u>
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE					
THAILAND					
Thailand Government Bond, Series ILB	1.25%	03/12/2028	THB 17,369	544,985	1.0
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
SCHATZPAPIERE					
Malaysia Government Bond, Series 0519	4.64%	11/15/2049	MYR 960	233,454	0.4
Gesamtanlagen				<u>\$ 53,315,154</u>	<u>97.6%</u>
Termineinlagen					
ANZ, London(a)	(0.13)%	—		138	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(a)	0.01 %	—		57	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	0.01 %	—		381	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	2.99 %	—		506	0.0
Citibank, New York(a)	0.01 %	—		2,257,465	4.1
Sumitomo, London(a)	0.01 %	—		95	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>2,258,642</u>	<u>4.1</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(931,878)</u>	<u>(1.7)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 54,641,918</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Korea 10 Yr Bond Futures	06/15/2021	34	\$ 3,856,972	\$ 3,829,840	\$ (27,132)
Short					
Korea 3 Yr Bond Futures	06/15/2021	26	2,581,816	2,585,080	(3,264)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	48	6,333,352	6,333,000	352
					<u>\$ (30,044)</u>
				Wertsteigerung	\$ 352
				Wertminderung	\$ (30,396)

DEISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	IDR 7,303,582	USD 510	07/15/2021	\$ 1,459
Bank of America, NA.	KRW 3,186,317	USD 2,866	07/22/2021	5,789
Barclays Bank PLC	INR 334,817	USD 4,498	07/15/2021	(91,964)
Barclays Bank PLC	USD 2,295	IDR 33,679,381	07/15/2021	49,779
Barclays Bank PLC	USD 662	MYR 2,740	09/23/2021	(1,022)
BNP Paribas SA.	USD 962	CNH 6,200	06/24/2021	11,238
BNP Paribas SA.	IDR 1,675,499	USD 117	07/15/2021	693
BNP Paribas SA.	THB 98,063	USD 3,154	07/15/2021	16,572
BNP Paribas SA.	USD 99	IDR 1,426,561	07/15/2021	521
BNP Paribas SA.	USD 1,223	INR 92,597	07/15/2021	46,514
BNP Paribas SA.	KRW 981,723	USD 875	07/22/2021	(6,135)
BNP Paribas SA.	USD 2,043	INR 153,467	08/09/2021	52,491
Brown Brothers Harriman & Co.	THB 4,216	USD 135	07/15/2021	128
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 45	USD 0*	08/19/2021	3

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 6,930	AUD 8,932	06/30/2021	\$ (43,767)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 4,105	CAD 4,974	06/30/2021	11,586
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,677	EUR 1,371	06/30/2021	(3,581)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	CNH 7,757	USD 1,183	06/24/2021	(35,321)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 2,964	GBP 2,095	06/30/2021	9,476
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 190	SGD 252	06/30/2021	309
Citibank, NA	IDR 33,679,381	USD 2,284	07/15/2021	(60,874)
Citibank, NA	USD 2,356	IDR 34,594,359	07/15/2021	52,656
Citibank, NA	KRW 443,259	USD 394	07/22/2021	(3,779)
Citibank, NA	USD 193	PHP 9,461	07/22/2021	4,653
Goldman Sachs Bank USA	IDR 2,693,146	USD 185	07/15/2021	(2,388)
Goldman Sachs Bank USA	USD 97	INR 7,085	07/15/2021	211
Goldman Sachs Bank USA	USD 10	TWD 288	07/22/2021	200
Goldman Sachs Bank USA	SGD 1,835	USD 1,386	08/19/2021	(1,138)
HSBC Bank USA	CNH 5,293	USD 819	06/24/2021	(11,717)
HSBC Bank USA	USD 1,127	CNH 7,356	06/24/2021	27,973
HSBC Bank USA	INR 28,255	USD 381	07/15/2021	(6,564)
HSBC Bank USA	USD 2,491	SGD 3,311	08/19/2021	12,135
JPMorgan Chase Bank, NA	INR 18,908	USD 251	07/15/2021	(8,517)
JPMorgan Chase Bank, NA	KRW 136,785	USD 122	07/22/2021	(289)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 1,783	MYR 7,375	09/23/2021	(3,967)
Royal Bank of Scotland PLC	IDR 13,787,640	USD 932	07/15/2021	(28,085)
Royal Bank of Scotland PLC	KRW 1,004,281	USD 900	07/22/2021	(1,508)
Standard Chartered Bank	INR 175,791	USD 2,363	07/15/2021	(46,384)
Standard Chartered Bank	USD 156	IDR 2,264,615	07/15/2021	1,879
Standard Chartered Bank	USD 7,251	KRW 8,082,299	07/22/2021	4,361
UBS AG	USD 2,512	KRW 2,834,953	07/22/2021	32,625
				<u>\$ (13,749)</u>
			Wertsteigerung	\$ 343,251
			Wertminderung	\$ (357,000)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

(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
JPY – Japanese Yen
KRW – South Korean Won
MYR – Malaysian Ringgit
PHP – Philippine Peso
SGD – Singapore Dollar
THB – Thailand Baht
TWD – New Taiwan Dollar
USD – United States Dollar

Glossar:

CBT – Chicago Board of Trade
REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
ABJA Investment Co. Pte Ltd.	5.45%	01/24/2028	USD 870	\$ 923,488	0.7%
Absa Group Ltd.(a)	6.38%	05/27/2026	355	361,989	0.3
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	2.00%	04/29/2028	336	337,575	0.2
Abu Dhabi Ports Co. PJSC	2.50%	05/06/2031	350	348,141	0.3
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.20%	08/04/2027	360	382,905	0.3
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.38%	07/03/2029	290	305,240	0.2
Adani Transmission Ltd.	4.00%	08/03/2026	336	359,177	0.3
ADIB Capital Invest 2 Ltd.(a)	7.13%	09/20/2023	400	437,450	0.3
Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA	6.75%	03/30/2029	1,110	1,170,356	0.8
AES El Salvador Trust II	6.75%	03/28/2023	200	198,125	0.1
AES Gener SA	6.35%	10/07/2079	450	477,009	0.3
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	368	377,269	0.3
AI Candelaria Spain SLU	7.50%	12/15/2028	420	475,658	0.3
Aldar Sukuk No 2 Ltd.	3.88%	10/22/2029	390	420,420	0.3
Alfa SAB de CV	5.25%	03/25/2024	630	689,968	0.5
Alibaba Group Holding Ltd.	2.70%	02/09/2041	500	464,879	0.3
Alpek SAB de CV	3.25%	02/25/2031	251	250,686	0.2
Altice Financing SA	7.50%	05/15/2026	295	307,139	0.2
AngloGold Ashanti Holdings PLC	6.50%	04/15/2040	536	649,665	0.5
Axiata SPV2 Bhd	2.16%	08/19/2030	345	334,823	0.2
Axtel SAB de CV	6.38%	11/14/2024	609	634,045	0.5
Banco BTG Pactual SA/Cayman Islands	7.75%	02/15/2029	230	248,443	0.2
Banco de Credito del Peru	3.13%	07/01/2030	471	462,758	0.3
Banco de Credito del Peru	3.25%	09/30/2031	615	605,775	0.4
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	3.73%	09/25/2034	865	883,003	0.6
Banistmo SA	4.25%	07/31/2027	550	570,900	0.4
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	3.75%	03/30/2026	236	240,012	0.2
Bank of East Asia Ltd. (The)(a)	5.88%	09/19/2024	250	265,828	0.2
Bank Tabungan Negara Persero Tbk PT	4.20%	01/23/2025	560	571,130	0.4
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.	0.00%	06/05/2034	221	164,195	0.1
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	1,640	1,728,150	1.2
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	1,270	1,317,625	0.9
Braskem Netherlands Finance BV	5.88%	01/31/2050	287	307,607	0.2
Braskem Netherlands Finance BV	8.50%	01/23/2081	300	348,390	0.3
Bukit Makmur Mandiri Utama PT	7.75%	02/10/2026	378	391,230	0.3
Canacol Energy Ltd.	7.25%	05/03/2025	680	716,252	0.5
CBQ Finance Ltd.	2.00%	09/15/2025	313	315,206	0.2
Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031	387	387,242	0.3
Cemex SAB de CV	5.20%	09/17/2030	360	392,018	0.3
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	470	385,283	0.3
China Development Bank Financial Leasing Co., Ltd.	2.88%	09/28/2030	480	484,536	0.3
Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024	133	136,337	0.1
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	110	113,143	0.1
CMB Wing Lung Bank Ltd.(a)	6.50%	01/24/2024	770	827,894	0.6
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025	200	201,487	0.1
Contemporary Ruiding Development Ltd.	2.63%	09/17/2030	355	349,562	0.3
Corp. Inmobiliaria Vesta SAB De	3.63%	05/13/2031	375	374,836	0.3
COSL Singapore Capital Ltd.	2.50%	06/24/2030	248	234,019	0.2
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	600	658,500	0.5
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023	387	401,827	0.3
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	200	214,975	0.2
DBS Group Holdings Ltd., Series G(a)	3.30%	02/27/2025	200	204,250	0.1
Delek & Avner Tamar Bond Ltd.	5.08%	12/30/2023	300	302,496	0.2
Delek & Avner Tamar Bond Ltd.	5.41%	12/30/2025	400	401,875	0.3
Delek royalty on Leviathan Ltd.	7.49%	12/30/2023	450	460,125	0.3
Digicel Holdings Bermuda Ltd./Digicel International Finance Ltd.	8.75%	05/25/2024	467	484,117	0.3
Digicel Ltd.	6.75%	03/01/2023	520	493,838	0.4
Doha Finance Ltd.	2.38%	03/31/2026	520	524,794	0.4
Ecopetrol SA	4.13%	01/16/2025	400	418,500	0.3
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045	480	495,600	0.4
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	585	691,031	0.5
El Puerto de Liverpool SAB de CV	3.88%	10/06/2026	964	1,038,228	0.7
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	1,425	1,513,172	1.1
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	560	637,233	0.5
Emirates Semb Corp. Water & Power Co. PJSC	4.45%	08/01/2035	260	295,669	0.2
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	591	604,561	0.4
Empresa Nacional de Telecomunicaciones SA	4.75%	08/01/2026	340	376,295	0.3
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	398	391,075	0.3
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	02/15/2031	779	759,681	0.5
Enel Americas SA	4.00%	10/25/2026	300	325,369	0.2
Energuate Trust	5.88%	05/03/2027	581	605,257	0.4
Equate Petrochemical BV	2.63%	04/28/2028	996	1,002,819	0.7
Equate Petrochemical BV	4.25%	11/03/2026	262	291,775	0.2
Fenix Power Peru SA	4.32%	09/20/2027	827	840,738	0.6

AB SICAV I
Emerging Market Corporate Debt Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Fidelity Bank PLC	10.50%	10/16/2022	USD 240	\$ 255,045	0.2%
First Abu Dhabi Bank PJSC(a)	4.50%	04/05/2026	450	481,050	0.3
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	04/01/2023	419	427,380	0.3
First Quantum Minerals Ltd.	7.50%	04/01/2025	473	490,531	0.4
FPC Treasury Ltd.	4.50%	04/16/2023	270	283,289	0.2
Frontera Energy Corp.	9.70%	06/25/2023	890	873,312	0.6
Gazprom PJSC Via Gaz Capital SA.	4.95%	03/23/2027	1,295	1,438,907	1.0
Gohl Capital Ltd.	4.25%	01/24/2027	340	357,411	0.3
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.	6.25%	02/15/2025	1,560	1,342,481	0.9
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	1,355	1,160,222	0.8
Grupo Energia Bogota SA ESP	4.88%	05/15/2030	254	275,908	0.2
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	328	355,780	0.3
HKT Capital No. 5 Ltd.	3.25%	09/30/2029	318	334,762	0.2
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	200	207,038	0.2
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	730	775,534	0.6
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	3.75%	04/27/2022	744	561,720	0.4
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.(a)	4.50%	01/24/2022	1,000	610,000	0.4
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	4.50%	05/29/2029	520	343,200	0.2
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026	1,416	941,640	0.7
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.00%	11/19/2025	200	136,063	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	630	436,275	0.3
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	430	430,000	0.3
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR 20,000	274,701	0.2
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	USD 878	936,881	0.7
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	4.75%	01/15/2051	203	199,892	0.1
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV	4.88%	01/14/2048	346	345,632	0.2
InRetail Consumer	3.25%	03/22/2028	371	355,464	0.3
Intercorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027	790	789,753	0.6
Intercorp Peru Ltd.	3.88%	08/15/2029	200	193,000	0.1
Inversiones CMPC SA.	3.00%	04/06/2031	400	397,620	0.3
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	256	276,033	0.2
Iochpe-Maxion Austria GmbH/Maxion Wheels de Mexico S de RL de CV.	5.00%	05/07/2028	1,030	1,013,111	0.7
Israel Electric Corp. Ltd., Series G	4.25%	08/14/2028	374	414,739	0.3
Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island	3.88%	04/15/2031	560	554,848	0.4
Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island(a)	4.63%	02/27/2025	800	775,040	0.6
Jababeka International BV	6.50%	10/05/2023	360	351,518	0.3
JGC Ventures Pte Ltd.(b)	10.75%	08/30/2021	1,935	821,770	0.6
Jollibee Worldwide Pte Ltd.	4.75%	06/24/2030	910	949,812	0.7
Jsw Hydro Energy Ltd.	4.13%	05/18/2031	890	898,066	0.6
Kallpa Generacion SA	4.13%	08/16/2027	200	205,000	0.1
Kasikornbank PCL/Hong Kong	3.34%	10/02/2031	320	328,060	0.2
Klabin Austria GmbH	3.20%	01/12/2031	598	576,994	0.4
Kookmin Bank	2.50%	11/04/2030	300	295,425	0.2
Kookmin Bank, Series G	4.50%	02/01/2029	200	226,336	0.2
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	370	355,198	0.3
Krung Thai Bank PCL/Cayman Islands(a)	4.40%	03/25/2026	865	870,406	0.6
KWG Group Holdings Ltd.	6.00%	09/15/2022	210	212,927	0.2
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	266	295,392	0.2
Leviathan Bond Ltd.	6.75%	06/30/2030	174	195,727	0.1
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	7.25%	05/03/2023	215	223,170	0.2
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	251	256,648	0.2
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	399	458,717	0.3
LLPL Capital Pte Ltd.	6.88%	02/04/2039	365	422,256	0.3
Malayan Banking Bhd	3.91%	10/29/2026	560	565,530	0.4
Medco Bell Pte Ltd.	6.38%	01/30/2027	400	411,075	0.3
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	245	267,402	0.2
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	250	263,261	0.2
MercadoLibre, Inc.	2.38%	01/14/2026	200	199,801	0.1
Metinvest BV	7.75%	04/23/2023	380	405,484	0.3
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024	500	513,702	0.4
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	400	420,325	0.3
Minsur SA	6.25%	02/07/2024	740	792,910	0.6
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	246	263,881	0.2
National Central Cooling Co. PJSC.	2.50%	10/21/2027	299	296,384	0.2
Natura Cosméticos SA.	4.13%	05/03/2028	606	618,120	0.4
NBK Tier 1 Financing 2 Ltd.(a)	4.50%	08/27/2025	600	625,800	0.5
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027	570	590,876	0.4
OCP SA	4.50%	10/22/2025	610	651,289	0.5
OCP SA	5.63%	04/25/2024	244	266,006	0.2
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	2,287	22,869	0.0
OEC Finance Ltd.(c)	4.38%	10/25/2029	410	48,189	0.0
OEC Finance Ltd.(c)	5.25%	12/27/2033	113	13,246	0.0
OEC Finance Ltd.(c)	7.13%	12/26/2046	1,355	160,587	0.1
Ooredoo International Finance Ltd.	2.63%	04/08/2031	305	307,196	0.2
Ooredoo International Finance Ltd.	5.00%	10/19/2025	640	735,000	0.5

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte/ Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Oztel Holdings SPC Ltd.	6.63%	04/24/2028	USD 670	\$ 748,851	0.5%
Periama Holdings LLC/DE	5.95%	04/19/2026	610	657,386	0.5
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030	1,801	1,415,248	1.0
Petkim Petrokimya Holding AS	5.88%	01/26/2023	920	940,987	0.7
Petrobras Global Finance BV	6.75%	06/03/2050	272	305,931	0.2
Petrobras Global Finance BV	6.85%	06/05/2115	323	361,356	0.3
Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026	343	438,676	0.3
Philippine National Bank	3.28%	09/27/2024	300	315,056	0.2
PLDT, Inc.	2.50%	01/23/2031	550	538,313	0.4
Power Finance Corp. Ltd.	4.50%	06/18/2029	215	229,418	0.2
Prosus NV	3.68%	01/21/2030	784	828,394	0.6
QNB Finance Ltd.	2.63%	05/12/2025	600	627,113	0.5
Rizal Commercial Banking Corp.(a)	6.50%	08/27/2025	200	205,725	0.1
Royal Capital BV(a)	5.88%	05/05/2022	400	412,700	0.3
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.	0.00%	09/30/2036	200	142,731	0.1
SABIC Capital II BV	4.50%	10/10/2028	207	237,571	0.2
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	460	484,344	0.3
Sands China Ltd.	3.80%	01/08/2026	644	690,687	0.5
Sands China Ltd.	4.60%	08/08/2023	475	505,880	0.4
Sands China Ltd.	5.40%	08/08/2028	421	481,540	0.3
Sasol Financing USA LLC	5.88%	03/27/2024	580	621,252	0.4
Saudi Arabian Oil Co.	2.25%	11/24/2030	650	634,887	0.5
SEPLAT Petroleum Development Co. PLC	7.75%	04/01/2026	2,217	2,283,510	1.6
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	3.34%	02/05/2030	580	608,202	0.4
SK Hynix, Inc.	2.38%	01/19/2031	363	349,812	0.3
SM Investments Corp.	4.88%	06/10/2024	600	646,410	0.5
Star Energy Geothermal Darajat II/Star Energy Geothermal Salak. ...	4.85%	10/14/2038	570	629,933	0.5
Stillwater Mining Co.	7.13%	06/27/2025	505	524,374	0.4
Studio City Finance Ltd.	6.00%	07/15/2025	590	619,979	0.4
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	231	239,608	0.2
Suzano Austria GmbH	5.00%	01/15/2030	270	302,717	0.2
Suzano Austria GmbH	6.00%	01/15/2029	283	334,639	0.2
Tencent Holdings Ltd.	2.39%	06/03/2030	1,020	1,006,532	0.7
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	630	682,006	0.5
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	3.15%	10/01/2026	1,471	1,382,740	1.0
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.13%	01/31/2025	400	436,757	0.3
Thaioil Treasury Center Co., Ltd.	4.63%	11/20/2028	297	333,345	0.2
TMBThanachart Bank PCL(a)	4.90%	12/02/2024	900	909,169	0.7
TNB Global Ventures Capital Bhd.	3.24%	10/19/2026	390	416,325	0.3
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	669	737,280	0.5
Trust Fibra Uno	6.39%	01/15/2050	233	267,338	0.2
Tullow Oil PLC	10.25%	05/15/2026	1,500	1,545,010	1.1
Türkiye Vakıflar Bankası TAO	6.50%	01/08/2026	284	286,751	0.2
Uep Penonome Ii SA	6.50%	10/01/2038	690	697,642	0.5
Ulker Bisküvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	600	647,737	0.5
United Overseas Bank Ltd.(a)	3.88%	10/19/2023	600	620,925	0.4
UPL Corp. Ltd.	4.63%	06/16/2030	600	632,256	0.5
Vedanta Resources Finance II PLC	8.95%	03/11/2025	662	658,687	0.5
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	949	1,046,476	0.8
Volcan Cia Minera SAA.	4.38%	02/11/2026	700	683,287	0.5
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	310	313,623	0.2
Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024	330	347,798	0.3
Woori Bank	4.75%	04/30/2024	225	247,613	0.2
Woori Bank	5.13%	08/06/2028	200	232,798	0.2
Woori Bank(a)	5.25%	05/16/2022	400	410,950	0.3
Wynn Macau Ltd.	5.13%	12/15/2029	200	206,603	0.2
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	324	339,560	0.2
YPF SA	8.50%	06/27/2029	820	559,138	0.4
YPF SA	8.75%	04/04/2024	470	398,090	0.3
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	7.38%	01/13/2026	240	209,904	0.2
Zhenro Properties Group Ltd.	8.35%	03/10/2024	200	207,168	0.2
Zorlu Yenilenebilir Enerji AS	9.00%	06/01/2026	892	865,240	0.6
				<u>108,481,263</u>	<u>77.9</u>
STAATSANLEIHEN					
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2030	1,195	439,903	0.3
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2035	8,913	2,931,704	2.1
Argentine Republic Government International Bond	0.13%	01/09/2038	116	45,669	0.0
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	510	197,897	0.1
Bahrain Government International Bond	6.25%	01/25/2051	530	494,059	0.4
Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028	330	369,084	0.3
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	335	324,531	0.2
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	245	256,071	0.2
Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	310	302,017	0.2
Saudi Government International Bond	3.75%	01/21/2055	810	826,352	0.6
Turkey Government International Bond	4.75%	01/26/2026	625	608,594	0.4

AB SICAV I
Emerging Market Corporate Debt Portfolio

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte/ Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Turkey Government International Bond	4.88%	04/16/2043	USD 395	\$ 307,297	0.2%
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2033	337	353,913	0.3
Ukraine Government International Bond, Series GDP(d)	0.00%	05/31/2040	1,222	1,351,685	1.0
				<u>8,808,776</u>	<u>6.3</u>
QUASI-STAATSANLEIHEN					
Airport Authority(a)	2.10%	03/08/2026	460	461,380	0.3
Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	517	509,245	0.4
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.15%	01/14/2030	270	278,826	0.2
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031	440	471,350	0.3
DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029	329	350,796	0.3
DP World Crescent Ltd.	4.85%	09/26/2028	458	518,542	0.4
Eskom Holdings SOC Ltd.	6.35%	08/10/2028	295	330,990	0.2
Eskom Holdings SOC Ltd.	6.75%	08/06/2023	400	420,200	0.3
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	678	718,256	0.5
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	226	246,679	0.2
JIC Zhixin Ltd.	2.13%	08/27/2030	345	326,844	0.2
Leader Goal International Ltd.(a)	4.25%	01/19/2023	200	203,912	0.1
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.38%	07/19/2022	240	245,293	0.2
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2026	200	202,538	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	315	353,548	0.3
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	1,649	1,448,646	1.0
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd.	2.70%	05/13/2030	240	242,895	0.2
State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025	272	292,315	0.2
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	930	953,134	0.7
				<u>8,575,389</u>	<u>6.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE					
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government Bond, Series 2030	8.00%	01/31/2030	ZAR 30,077	<u>2,062,023</u>	<u>1.5</u>
GELDMARKTINSTRUMENTE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
ÄGYPTEN					
Egypt Treasury Bills, Series 364D	0.00%	06/29/2021	EGP 10,275	<u>649,372</u>	<u>0.5</u>
SCHATZOBLIGATIONEN					
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6228.	7.65%	04/10/2030	RUB 42,689	<u>609,784</u>	<u>0.4</u>
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE					
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP 897,835	<u>209,982</u>	<u>0.1</u>
STAMMAKTEN					
Frontera Energy Corp.			5,250	<u>27,640</u>	<u>0.0</u>
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN					
SWAPTIONS					
CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index, Morgan Stanley & Co. International PLC Expiration: Jun 2021, Exercise Rate:	1.07%		18,710,000	<u>13,360</u>	<u>0.0</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	USD 126	130,992	0.1
Digicel Group Holdings Ltd.(c)	10.00%	04/01/2024	1,766	1,734,628	1.2
Digicel Group Holdings Ltd.(a) (c)	7.00%	06/14/2021	140	105,291	0.1
Digicel Group Holdings Ltd.(c)	8.00%	04/01/2025	373	313,491	0.2
Tonon Luxembourg SA(b) (c) (e)	6.50%	10/31/2024	526	5,315	0.0
USJ-Acucar e Alcool S/A(b)	9.88%	11/09/2023	1,238	370,953	0.3
Virgolino de Oliveira Finance SA(f)	10.50%	01/28/2018	818	8,160	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(f)	10.88%	01/13/2020	200	68,000	0.1
Virgolino de Oliveira Finance SA(b)	11.75%	02/09/2022	450	<u>2,244</u>	<u>0.0</u>
				<u>2,739,074</u>	<u>2.0</u>
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE					
Fideicomiso PA Costera	6.25%	01/15/2034	COP 877,400	<u>245,401</u>	<u>0.2</u>
				<u>2,984,475</u>	<u>2.2</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$136,021,378)				<u>\$132,422,064</u>	<u>95.0%</u>
Termineinlagen					
JPMorgan Chase, New York(g)	0.01 %	—		<u>5,658,084</u>	<u>4.1</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					
				<u>1,239,277</u>	<u>0.9</u>
Nettovermögen					
				<u>\$139,319,425</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	13	\$ 1,712,547	\$ 1,715,188	\$ 2,641
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2021	8	1,486,399	1,482,000	(4,399)
					\$ (1,758)
				Wertsteigerung	\$ 2,641
				Wertminderung	\$ (4,399)

DEVEISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	USD 1,373	BRL 7,235	06/02/2021	\$ 15,472
Bank of America, NA	USD 626	RUB 46,492	07/28/2021	3,771
Barclays Bank PLC	INR 92,430	USD 1,260	07/15/2021	(7,151)
Barclays Bank PLC	USD 1,205	INR 92,083	07/15/2021	57,496
BNP Paribas SA	ZAR 7,980	USD 557	06/17/2021	(20,857)
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR 3,092	USD 221	06/17/2021	(2,447)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 16	CNH 101	06/07/2021	323
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 32	AUD 41	06/30/2021	(200)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 24	CAD 29	06/30/2021	68
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 135	EUR 110	06/30/2021	(289)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 14	GBP 10	06/30/2021	45
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 14	NZD 19	06/30/2021	(101)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 39	SGD 52	06/30/2021	64
Citibank, NA	ZAR 9,683	USD 680	06/17/2021	(21,305)
Citibank, NA	COP 1,788,600	USD 476	07/15/2021	(5,017)
Deutsche Bank AG	INR 19,802	USD 266	07/15/2021	(5,350)
Deutsche Bank AG	USD 1,389	EUR 1,134	08/03/2021	(4,720)
Goldman Sachs Bank USA	BRL 7,235	USD 1,362	06/02/2021	(26,214)
Goldman Sachs Bank USA	USD 706	MXN 14,122	06/18/2021	2,105
Goldman Sachs Bank USA	USD 1,358	BRL 7,235	07/02/2021	25,962
JPMorgan Chase Bank, NA	ZAR 8,024	USD 569	06/17/2021	(11,624)
UBS AG	USD 686	MXN 13,631	06/18/2021	(3,290)
UBS AG	USD 809	RUB 60,253	07/28/2021	6,564
				\$ 3,305
				Wertsteigerung \$ 111,870
				Wertminderung \$ (108,565)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

VERKAUFTE CREDIT-DEFAULT-SWAPTION

Referenz-Obligation	Gegenpartei	Kauf-/Verkaufsschutz	Ausübungskurs	Fälligkeit	Nominalbetrag (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Call - CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	Morgan Stanley & Co. International PLC	Sell	110.00%	06/16/21	USD 18,710	\$ 45,840	\$ (18,904)
Put - CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	Morgan Stanley & Co. International PLC	Sell	105.00%	06/16/21	18,710	65,485	(9,189)
						\$ 111,325	\$ (28,093)

INFLATIONSSWAPS

Kontrahent	Nomineller Betrag (000)	Abschlussdatum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	USD 2,800	05/21/2031	CPI#	2.645%	\$ 22,750
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	910	02/22/2051	CPI#	2.348%	(40,278)
Insgesamt					\$ (17,528)
				Wertsteigerung	\$ 22,750
				Wertminderung	\$ (40,278)

Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 3,050	05/21/2031	1.645%	3 Month LIBOR	\$ (17,016)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	1,380	02/22/2051	1.854%	3 Month LIBOR	48,603
Insgesamt					<u>\$ 31,587</u>
				Wertsteigerung	\$ 48,603
				Wertminderung	\$ (17,016)
Swaps insgesamt					<u><u>\$ 14,059</u></u>

- (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 2021.
- (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
 BRL – Brazilian Real
 CAD – Canadian Dollar
 CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
 COP – Colombian Peso
 EGP – Egyptian Pound
 EUR – Euro
 GBP – Great British Pound
 INR – Indian Rupee
 MXN – Mexican Peso
 NZD – New Zealand Dollar
 RUB – Russian Ruble
 SGD – Singapore Dollar
 USD – United States Dollar
 ZAR – South African Rand

Glossar:

CBT – Chicago Board of Trade
 CDX-NAHY – North American High Yield Credit Default Swap Index
 CME – Chicago Mercantile Exchange
 CPI – Consumer Price Index
 LCH – London Clearing House
 PJSC – Public Joint Stock Company

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
Advanced Drainage Systems, Inc.	5.00%	09/30/2027	USD	43	\$ 44,825	0.0%
Arconic Corp.	6.13%	02/15/2028		37	39,467	0.0
Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV	4.75%	06/15/2027		180	187,200	0.1
Big River Steel LLC/BRS Finance Corp.	6.63%	01/31/2029		65	70,852	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043		306	345,041	0.2
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034		37	43,637	0.0
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044		269	314,264	0.2
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025		313	366,385	0.2
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. VI	4.75%	02/01/2026		90	93,400	0.1
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031		328	342,222	0.2
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	5.13%	05/15/2024		182	198,264	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.45%	03/15/2043		305	368,172	0.2
Graham Packaging Co., Inc.	7.13%	08/15/2028		39	41,574	0.0
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027		42	45,180	0.0
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.	7.38%	12/15/2023		253	258,352	0.2
Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV, Inc.	9.00%	07/01/2028		137	151,393	0.1
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	EUR	183	227,812	0.2
INEOS Quattro Finance 2 PLC	3.38%	01/15/2026	USD	221	221,118	0.1
Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028		140	138,391	0.1
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(a)	9.00%	01/15/2026		158	161,712	0.1
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028		366	378,820	0.2
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	8.50%	08/01/2028		210	232,139	0.2
Kraton Polymers LLC/Kraton Polymers Capital Corp.	4.25%	12/15/2025		125	126,825	0.1
Kraton Polymers LLC/Kraton Polymers Capital Corp.	5.25%	05/15/2026	EUR	100	125,193	0.1
Mercer International, Inc.	5.13%	02/01/2029	USD	43	44,355	0.0
NOVA Chemicals Corp.	4.88%	06/01/2024		80	84,037	0.1
NOVA Chemicals Corp.	5.25%	06/01/2027		150	160,955	0.1
Novelis Corp.	5.88%	09/30/2026		169	176,220	0.1
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029		165	179,413	0.1
Peabody Energy Corp.	6.38%	03/31/2025		100	58,266	0.0
Peabody Energy Corp.(a)	8.50%	12/31/2024		67	42,367	0.0
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.	10.00%	12/31/2024		76	73,530	0.1
Reynolds Group Issuer, Inc./Reynolds Group Issuer LLC/Reynolds Group Issuer Lu	4.00%	10/15/2027		281	275,998	0.2
SpA Holdings 3 Oy	4.88%	02/04/2028		303	305,065	0.2
SPCM SA	4.88%	09/15/2025		403	412,908	0.3
TPC Group, Inc.	10.50%	08/01/2024		90	84,323	0.1
Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030		367	375,050	0.2
WR Grace & Co.-Conn	4.88%	06/15/2027		46	48,454	0.0
WR Grace & Co.-Conn	5.63%	10/01/2024		50	54,920	0.0
					6,898,099	4.3
INVESTITIONSGÜTER						
ARD Finance SA(a)	5.00%	06/30/2027	EUR	192	239,091	0.1
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC	4.00%	09/01/2029	USD	457	450,145	0.3
Bombardier, Inc.	6.00%	10/15/2022		246	246,281	0.2
Bombardier, Inc.	6.13%	01/15/2023		80	84,017	0.1
Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024		452	464,566	0.3
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025		169	170,341	0.1
Clean Harbors, Inc.	4.88%	07/15/2027		72	75,675	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029		87	94,087	0.1
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026		12	12,661	0.0
Crown Americas LLC/Crown Americas Capital Corp. IV	4.50%	01/15/2023		117	123,243	0.1
EnerSys	4.38%	12/15/2027		130	134,901	0.1
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026		299	304,844	0.2
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026		401	421,050	0.3
GFL Environmental, Inc.	3.50%	09/01/2028		192	186,660	0.1
GFL Environmental, Inc.	4.00%	08/01/2028		148	142,817	0.1
GFL Environmental, Inc.	5.13%	12/15/2026		70	73,563	0.0
GFL Environmental, Inc.	8.50%	05/01/2027		56	61,414	0.0
Granite US Holdings Corp.	11.00%	10/01/2027		185	206,622	0.1
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028		78	82,407	0.1
Mueller Water Products, Inc.	4.00%	06/15/2029		239	243,835	0.2
Mueller Water Products, Inc.	5.50%	06/15/2026		108	111,124	0.1
RBS Global, Inc./Rexnord LLC	4.88%	12/15/2025		118	120,527	0.1
Signature Aviation US Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2028		150	150,536	0.1
SPX FLOW, Inc.	5.88%	08/15/2026		214	221,556	0.1
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026		28	29,933	0.0
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	5.25%	01/15/2029		37	39,119	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Tervita Corp.	11.00%	12/01/2025	USD 272	\$ 305,622	0.2%
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	48	48,935	0.0
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025	69	70,553	0.0
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	136	150,545	0.1
Vertical Holdco GmbH	7.63%	07/15/2028	200	215,801	0.1
Vertical US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	355	369,304	0.2
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	155	167,450	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	113	125,318	0.1
				<u>5,944,543</u>	<u>3.7</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	425	451,029	0.3
Altice Financing SA.	5.00%	01/15/2028	885	877,719	0.6
AMC Networks, Inc.	4.25%	02/15/2029	312	309,801	0.2
AMC Networks, Inc.	5.00%	04/01/2024	77	78,089	0.1
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028	30	30,654	0.0
Banijay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	295	301,933	0.2
Cable One, Inc.	4.00%	11/15/2030	58	57,478	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.25%	02/01/2031	150	149,706	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.00%	03/01/2023	253	255,646	0.2
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	296	301,570	0.2
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	221	220,691	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.75%	03/01/2030	65	67,454	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.00%	02/01/2028	504	527,989	0.3
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.13%	05/01/2027	491	514,469	0.3
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.75%	02/15/2026	880	909,878	0.6
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	333	335,970	0.2
CSC Holdings LLC	3.38%	02/15/2031	346	323,948	0.2
CSC Holdings LLC	4.50%	11/15/2031	392	390,738	0.2
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	392	390,900	0.2
CSC Holdings LLC	6.50%	02/01/2029	725	793,123	0.5
DISH DBS Corp.	5.88%	07/15/2022	77	80,085	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	64	68,134	0.0
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026	745	846,145	0.5
DISH Network Corp.(b).	3.38%	08/15/2026	85	87,957	0.1
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	105	107,011	0.1
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	98	104,678	0.1
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027	231	246,991	0.2
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	27	28,411	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	625	668,826	0.4
Liberty Interactive LLC	8.25%	02/01/2030	22	25,282	0.0
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026	428	447,185	0.3
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	172	150,899	0.1
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	194	185,198	0.1
Netflix, Inc.	3.63%	05/15/2027	EUR 396	554,181	0.4
Netflix, Inc.	4.63%	05/15/2029	364	553,185	0.3
Netflix, Inc.	4.88%	04/15/2028	USD 150	172,406	0.1
Netflix, Inc.	5.88%	11/15/2028	175	211,605	0.1
Scripps Escrow II, Inc.	5.38%	01/15/2031	64	64,190	0.0
Scripps Escrow, Inc.	5.88%	07/15/2027	124	128,262	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	4.13%	12/01/2030	158	154,190	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.13%	02/15/2027	176	176,161	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	106	105,897	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	08/01/2022	95	95,418	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	4.63%	07/15/2024	91	93,304	0.1
Sirius XM Radio, Inc.	5.00%	08/01/2027	64	66,981	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.38%	07/15/2026	40	41,231	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	543	585,837	0.4
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	EUR 100	127,164	0.1
TEGNA, Inc.	4.63%	03/15/2028	USD 157	160,416	0.1
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	429	438,408	0.3
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	116	117,405	0.1
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	191	206,982	0.1
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025	150	165,611	0.1
UPC Broadband Finco BV.	4.88%	07/15/2031	231	230,723	0.1
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	415	439,328	0.3
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	08/15/2026	638	661,977	0.4
				<u>15,886,449</u>	<u>10.0</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	5.13%	07/15/2029	494	489,863	0.3
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026	371	385,819	0.2
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	582	603,790	0.4
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	79	80,541	0.1
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	411	444,321	0.3
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	521	586,659	0.4
Frontier Communications Holdings LLC	5.88%	10/15/2027	91	96,684	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Frontier Communications Holdings LLC	6.75%	05/01/2029	USD 61	\$ 63,655	0.0%
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	53	58,861	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	5.50%	08/01/2023	697	407,083	0.3
Level 3 Financing, Inc.	3.75%	07/15/2029	223	215,317	0.1
Level 3 Financing, Inc.	5.25%	03/15/2026	56	57,684	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series T	5.80%	03/15/2022	217	223,862	0.1
Lumen Technologies, Inc., Series S	6.45%	06/15/2021	313	313,563	0.2
Nexstar Broadcasting, Inc.	5.63%	07/15/2027	88	93,099	0.1
Sprint Capital Corp.	8.75%	03/15/2032	144	213,516	0.1
Sprint Communications, Inc.	6.00%	11/15/2022	378	401,699	0.2
Sprint Corp.	7.13%	06/15/2024	720	829,422	0.5
Sprint Corp.	7.88%	09/15/2023	161	182,247	0.1
T-Mobile USA, Inc.	2.63%	02/15/2029	253	244,216	0.2
T-Mobile USA, Inc.	2.88%	02/15/2031	559	539,667	0.3
T-Mobile USA, Inc.	3.38%	04/15/2029	148	150,366	0.1
T-Mobile USA, Inc.	3.50%	04/15/2031	396	402,361	0.3
T-Mobile USA, Inc.	4.50%	02/01/2026	492	503,492	0.3
T-Mobile USA, Inc.	4.75%	02/01/2028	6	6,415	0.0
Telecom Italia Capital SA	6.38%	11/15/2033	44	50,960	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	218	270,397	0.2
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	66	86,465	0.1
Zayo Group Holdings, Inc.	6.13%	03/01/2028	111	112,978	0.1
				<u>8,115,002</u>	<u>5.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient Global Holdings Ltd.	4.88%	08/15/2026	303	310,699	0.2
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025	160	176,792	0.1
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029	147	159,853	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	04/01/2025	168	173,712	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	150	162,775	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd.	10.50%	11/30/2025	247	272,593	0.2
Aston Martin Capital Holdings Ltd.(a)	15.00%	11/30/2026	215	235,717	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	152	162,304	0.1
Dana Financing Luxembourg SARL	6.50%	06/01/2026	243	251,188	0.2
Dana, Inc.	4.25%	09/01/2030	70	72,271	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028	165	174,190	0.1
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023	449	501,343	0.3
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025	129	157,600	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	3.10%	05/04/2023	200	204,028	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	3.22%	01/09/2022	889	898,381	0.6
Ford Motor Credit Co. LLC	4.00%	11/13/2030	400	408,651	0.3
Ford Motor Credit Co. LLC	4.06%	11/01/2024	650	686,700	0.4
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	124	126,575	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.25%	07/15/2031	113	115,491	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.00%	05/15/2027	200	210,721	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	277	282,138	0.2
Jaguar Land Rover Automotive PLC	6.88%	11/15/2026	EUR 179	249,435	0.2
Meritor, Inc.	4.50%	12/15/2028	USD 310	311,550	0.2
Meritor, Inc.	6.25%	02/15/2024	15	15,156	0.0
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	26	27,664	0.0
Navistar International Corp.	6.63%	11/01/2025	232	240,078	0.2
PM General Purchaser LLC	9.50%	10/01/2028	473	517,138	0.3
Real Hero Merger Sub 2, Inc.	6.25%	02/01/2029	42	43,378	0.0
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2026	63	62,540	0.0
Tenneco, Inc.	5.13%	04/15/2029	236	235,988	0.1
Titan International, Inc.	7.00%	04/30/2028	231	240,634	0.2
				<u>7,687,283</u>	<u>4.8</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Boyne USA, Inc.	4.75%	05/15/2029	93	95,834	0.1
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	572	607,750	0.4
Carnival Corp.	9.88%	08/01/2027	87	101,790	0.1
Carnival Corp.	10.50%	02/01/2026	191	224,425	0.1
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023	259	296,174	0.2
Carnival PLC	1.00%	10/28/2029	EUR 139	139,116	0.1
Cedar Fair LP	5.25%	07/15/2029	USD 24	24,438	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp.	5.38%	06/01/2024	190	191,888	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp./Millennium Op	5.38%	04/15/2027	115	117,948	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp./Millennium Op	5.50%	05/01/2025	484	505,609	0.3
Constellation Merger Sub, Inc.	8.50%	09/15/2025	21	20,603	0.0
Mattel, Inc.	3.38%	04/01/2026	301	311,986	0.2
Mattel, Inc.	3.75%	04/01/2029	377	385,974	0.2
Mattel, Inc.	6.75%	12/31/2025	19	19,991	0.0
NCL Corp., Ltd.	3.63%	12/15/2024	392	374,919	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	USD 583	\$ 612,879	0.4%
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	175	200,812	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	436	504,670	0.3
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025	100	108,202	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	9.50%	08/01/2025	165	178,033	0.1
Silversea Cruise Finance Ltd.	7.25%	02/01/2025	35	36,223	0.0
Six Flags Entertainment Corp.	4.88%	07/31/2024	121	122,341	0.1
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	74	79,747	0.1
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	208	221,742	0.1
Viking Cruises Ltd.	5.88%	09/15/2027	56	54,231	0.0
Viking Cruises Ltd.	7.00%	02/15/2029	106	108,868	0.1
Viking Cruises Ltd.	13.00%	05/15/2025	162	189,696	0.1
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5.63%	02/15/2029	106	107,423	0.1
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	111	111,833	0.1
				<u>6,055,145</u>	<u>3.8</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	173	182,049	0.1
Ashton Woods USA LLC/Ashton Woods Finance Co.	6.75%	08/01/2025	31	32,220	0.0
Bally's Corp.	6.75%	06/01/2027	360	382,748	0.2
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	97	100,465	0.1
Boyd Gaming Corp.	8.63%	06/01/2025	128	140,989	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	60	59,060	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	349	368,272	0.2
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	258	272,047	0.2
Caesars Holdings, Inc.(b)	5.00%	10/01/2024	12	30,184	0.0
Churchill Downs, Inc.	5.50%	04/01/2027	184	191,360	0.1
CP Atlas Buyer, Inc.	7.00%	12/01/2028	68	70,315	0.0
Empire Communities Corp.	7.00%	12/15/2025	209	221,677	0.1
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025	256	270,584	0.2
Forestar Group, Inc.	3.85%	05/15/2026	154	154,697	0.1
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp.	6.50%	07/15/2025	187	201,535	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	3.63%	02/15/2032	578	566,746	0.4
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	4.88%	01/15/2030	27	28,737	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025	68	71,528	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.75%	05/01/2028	74	79,733	0.1
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029	153	154,635	0.1
Hilton Grand Vacations Borrower LLC/Hilton Grand Vacations Borrower, Inc.	6.13%	12/01/2024	43	45,260	0.0
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	119	125,250	0.1
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	400	452,813	0.3
K. Hovnanian Enterprises, Inc.	10.00%	07/15/2022	46	46,285	0.0
KB Home	7.50%	09/15/2022	28	30,170	0.0
KB Home	7.63%	05/15/2023	52	56,607	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	188	199,921	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC	6.50%	09/15/2026	285	296,922	0.2
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	120	119,732	0.1
Meritage Homes Corp.	5.13%	06/06/2027	55	61,974	0.0
MGM Resorts International	5.75%	06/15/2025	25	27,436	0.0
MGM Resorts International	6.00%	03/15/2023	139	148,556	0.1
MGM Resorts International	7.75%	03/15/2022	150	157,325	0.1
Scientific Games International, Inc.	5.00%	10/15/2025	260	267,873	0.2
Scientific Games International, Inc.	7.00%	05/15/2028	130	140,625	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	256	256,401	0.2
Stars Group Holdings BV/Stars Group US Co-Borrower LLC	7.00%	07/15/2026	169	175,760	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	49	54,485	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	209	234,751	0.2
Taylor Morrison Communities, Inc./Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.63%	03/01/2024	66	71,860	0.1
Travel + Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	45	46,413	0.0
Travel + Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	90	103,037	0.1
Victors Merger Corp.	6.38%	05/15/2029	185	183,661	0.1
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	6	6,347	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025	602	641,753	0.4
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	96	100,003	0.1
				<u>7,630,801</u>	<u>4.8</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	4.00%	10/15/2030	243	235,400	0.2
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	3.50%	02/15/2029	260	254,355	0.2
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	5.75%	04/15/2025	204	216,165	0.1
IRB Holding Corp.	6.75%	02/15/2026	192	198,720	0.1
IRB Holding Corp.	7.00%	06/15/2025	85	91,798	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Yum! Brands, Inc.	4.63%	01/31/2032	USD 487	\$ 508,387	0.3%
Yum! Brands, Inc.	7.75%	04/01/2025	42	45,683	0.0
				<u>1,550,508</u>	<u>1.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(a)	7.75%	04/01/2027	28	29,058	0.0
Burlington Coat Factory Warehouse Corp.	6.25%	04/15/2025	63	67,983	0.0
Dufry One BV	2.50%	10/15/2024	EUR 331	398,882	0.2
Foundation Building Materials, Inc.	6.00%	03/01/2029	USD 107	104,911	0.1
L Brands, Inc.	5.25%	02/01/2028	49	53,251	0.0
L Brands, Inc.	6.63%	10/01/2030	83	94,889	0.1
L Brands, Inc.	6.75%	07/01/2036	129	153,761	0.1
L Brands, Inc.	6.88%	11/01/2035	337	405,806	0.3
L Brands, Inc.	7.50%	06/15/2029	44	50,782	0.0
L Brands, Inc.	9.38%	07/01/2025	26	33,102	0.0
LBM Acquisition LLC	6.25%	01/15/2029	63	64,414	0.0
Levi Strauss & Co.	3.50%	03/01/2031	95	93,575	0.1
Magic Mergeco, Inc.	5.25%	05/01/2028	239	241,771	0.2
Magic Mergeco, Inc.	7.88%	05/01/2029	218	222,310	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	5.63%	05/01/2027	63	66,519	0.0
NMG Holding Co., Inc./Neiman Marcus Group LLC	7.13%	04/01/2026	101	106,671	0.1
Party City Holdings, Inc.	8.75%	02/15/2026	75	79,448	0.0
Penske Automotive Group, Inc.	5.50%	05/15/2026	196	201,751	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	445	460,946	0.3
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	7.75%	02/15/2029	371	408,598	0.3
Rite Aid Corp.	7.50%	07/01/2025	105	109,066	0.1
Rite Aid Corp.	8.00%	11/15/2026	16	16,663	0.0
Sonic Automotive, Inc.	6.13%	03/15/2027	93	97,632	0.1
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	395	411,828	0.3
SRS Distribution, Inc.	6.13%	07/01/2029	55	56,100	0.0
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	65	67,435	0.0
Staples, Inc.	10.75%	04/15/2027	191	195,507	0.1
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024	89	97,836	0.1
White Cap Buyer LLC	6.88%	10/15/2028	113	119,168	0.1
William Carter Co. (The)	5.50%	05/15/2025	79	83,361	0.1
William Carter Co. (The)	5.63%	03/15/2027	125	130,954	0.1
				<u>4,723,978</u>	<u>3.0</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC	4.63%	08/01/2029	72	70,673	0.0
AdaptHealth LLC	6.13%	08/01/2028	140	147,471	0.1
Air Methods Corp.	8.00%	05/15/2025	14	13,133	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/Albertsons LLC	4.88%	02/15/2030	211	219,892	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/Albertsons LLC	5.75%	03/15/2025	35	35,943	0.0
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	197	211,416	0.1
Bausch Health Americas, Inc.	9.25%	04/01/2026	150	162,246	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	6.13%	04/15/2025	281	286,994	0.2
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	173	169,139	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	7.25%	05/30/2029	34	35,103	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	9.00%	12/15/2025	604	646,529	0.4
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	43	45,902	0.0
Charles River Laboratories International, Inc.	3.75%	03/15/2029	160	160,346	0.1
Charles River Laboratories International, Inc.	4.00%	03/15/2031	114	116,024	0.1
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	EUR 160	196,369	0.1
Chobani LLC/Chobani Finance Corp., Inc.	4.63%	11/15/2028	USD 23	23,740	0.0
Chobani LLC/Chobani Finance Corp., Inc.	7.50%	04/15/2025	50	52,004	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	4.75%	02/15/2031	580	569,298	0.4
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/01/2028	87	83,443	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/15/2029	1,067	1,095,989	0.7
Cidron Aida Finco SARL	5.00%	04/01/2028	EUR 193	238,262	0.2
DaVita, Inc.	3.75%	02/15/2031	USD 421	403,628	0.3
DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	193	197,087	0.1
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	280	274,936	0.2
Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc.	6.00%	06/30/2028	40	27,658	0.0
Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc.	9.50%	07/31/2027	117	119,048	0.1
Endo Luxembourg Finance Co. I Sarl/Endo US, Inc.	6.13%	04/01/2029	83	81,750	0.1
Fresh Market, Inc. (The)	9.75%	05/01/2023	27	27,812	0.0
Global Medical Response, Inc.	6.50%	10/01/2025	130	133,825	0.1
HCA, Inc.	5.38%	09/01/2026	52	59,051	0.0
HCA, Inc.	5.63%	09/01/2028	55	64,117	0.0
IQVIA, Inc.	5.00%	10/15/2026	200	207,537	0.1
Jazz Securities DAC	4.38%	01/15/2029	252	259,021	0.2
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	5.00%	12/31/2026	172	174,916	0.1
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	7.00%	12/31/2027	414	420,937	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Legacy LifePoint Health LLC	4.38%	02/15/2027	USD 17	\$ 16,957	0.0%
Legacy LifePoint Health LLC	6.75%	04/15/2025	130	137,876	0.1
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC(c)	5.50%	04/15/2025	11	6,851	0.0
MEDNAX, Inc.	6.25%	01/15/2027	36	38,186	0.0
ModivCare, Inc.	5.88%	11/15/2025	80	84,417	0.1
Newell Brands, Inc.	4.35%	04/01/2023	28	29,419	0.0
Newell Brands, Inc.	4.70%	04/01/2026	216	242,759	0.2
Newell Brands, Inc.	4.88%	06/01/2025	33	36,696	0.0
Newell Brands, Inc.	6.00%	04/01/2046	123	156,028	0.1
Organon Finance 1 LLC	5.13%	04/30/2031	344	353,635	0.2
Par Pharmaceutical, Inc.	7.50%	04/01/2027	175	178,580	0.1
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030	473	476,160	0.3
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	115	122,821	0.1
Post Holdings, Inc.	5.75%	03/01/2027	90	94,273	0.1
Primo Water Holdings, Inc.	4.38%	04/30/2029	310	310,392	0.2
Radiology Partners, Inc.	9.25%	02/01/2028	18	19,731	0.0
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./LifePoint Health, Inc.	9.75%	12/01/2026	476	513,045	0.3
RP Escrow Issuer LLC	5.25%	12/15/2025	80	82,801	0.1
Spectrum Brands, Inc.	3.88%	03/15/2031	299	291,464	0.2
Spectrum Brands, Inc.	5.75%	07/15/2025	2	2,051	0.0
Sunshine Mid BV	6.50%	05/15/2026	EUR 100	125,961	0.1
Tenet Healthcare Corp.	5.13%	05/01/2025	USD 30	30,421	0.0
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	10/01/2028	309	322,508	0.2
Tenet Healthcare Corp.	6.25%	02/01/2027	300	313,287	0.2
Tenet Healthcare Corp.	7.50%	04/01/2025	169	181,243	0.1
TreeHouse Foods, Inc.	4.00%	09/01/2028	66	65,628	0.0
Triton Water Holdings, Inc.	6.25%	04/01/2029	136	136,359	0.1
US Acute Care Solutions LLC	6.38%	03/01/2026	84	86,932	0.1
US Foods, Inc.	4.75%	02/15/2029	446	444,589	0.3
US Renal Care, Inc.	10.63%	07/15/2027	360	376,064	0.2
Vizient, Inc.	6.25%	05/15/2027	68	71,857	0.0
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	62	64,583	0.0
				<u>12,444,813</u>	<u>7.8</u>

ENERGIE

Antero Resources Corp.	7.63%	02/01/2029	99	108,903	0.1
Antero Resources Corp.	8.38%	07/15/2026	104	117,315	0.1
Apache Corp.	4.38%	10/15/2028	433	444,145	0.3
Apache Corp.	4.63%	11/15/2025	30	31,854	0.0
Apache Corp.	4.88%	11/15/2027	61	64,043	0.0
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026	384	379,922	0.2
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	39	40,682	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	559	604,623	0.4
Bonanza Creek Energy, Inc.	7.50%	04/30/2026	10	10,272	0.0
Callon Petroleum, Co.	6.25%	04/15/2023	112	106,078	0.1
Callon Petroleum, Co.	8.25%	07/15/2025	38	36,001	0.0
Cheniere Energy Partners LP	5.63%	10/01/2026	103	107,169	0.1
Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024	26	26,652	0.0
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	104	106,972	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	220	228,716	0.1
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	101	107,688	0.1
Comstock Resources, Inc.	6.75%	03/01/2029	226	235,813	0.1
Comstock Resources, Inc.	7.50%	05/15/2025	111	115,107	0.1
DCP Midstream Operating LP	5.13%	05/15/2029	110	118,495	0.1
DCP Midstream Operating LP	5.60%	04/01/2044	250	261,300	0.2
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	359	359,176	0.2
EnLink Midstream LLC	5.63%	01/15/2028	355	369,577	0.2
EnLink Midstream Partners LP	4.15%	06/01/2025	236	241,113	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024	31	32,170	0.0
EnLink Midstream Partners LP	4.85%	07/15/2026	330	335,004	0.2
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	48	42,896	0.0
EQM Midstream Partners LP	4.50%	01/15/2029	253	253,078	0.2
EQM Midstream Partners LP	4.75%	01/15/2031	240	241,393	0.1
EQM Midstream Partners LP	5.50%	07/15/2028	76	81,101	0.1
EQT Corp.	3.00%	10/01/2022	28	28,599	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024	80	80,092	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025	11	11,083	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	215	216,150	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	184	189,964	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	261	281,931	0.2
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	96	101,715	0.1
Gulfport Energy Corp.	8.00%	05/17/2026	163	181,384	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	71	72,859	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	70	72,362	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.25%	11/01/2028	150	157,383	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Independence Energy Finance LLC	7.25%	05/01/2026	USD 311	\$ 315,235	0.2%
Indigo Natural Resources LLC	5.38%	02/01/2029	188	188,964	0.1
Moss Creek Resources Holdings, Inc.	10.50%	05/15/2027	139	131,695	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	94	83,638	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028	95	80,722	0.1
Nabors Industries, Inc.	5.75%	02/01/2025	180	149,325	0.1
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	486	493,514	0.3
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	355	369,175	0.2
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023	313	304,915	0.2
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023	186	187,229	0.1
Occidental Petroleum Corp.	2.90%	08/15/2024	569	568,358	0.4
Occidental Petroleum Corp.	3.40%	04/15/2026	30	29,356	0.0
Occidental Petroleum Corp.	3.50%	06/15/2025	129	129,159	0.1
Occidental Petroleum Corp.	5.50%	12/01/2025	133	143,234	0.1
Occidental Petroleum Corp.	5.55%	03/15/2026	865	925,600	0.6
Occidental Petroleum Corp.	6.13%	01/01/2031	417	462,439	0.3
Occidental Petroleum Corp.	6.20%	03/15/2040	110	115,946	0.1
Occidental Petroleum Corp.	8.50%	07/15/2027	110	133,863	0.1
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	110	141,042	0.1
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	9.25%	05/15/2025	395	406,446	0.3
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	348	362,656	0.2
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	85	86,945	0.1
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023	86	88,649	0.1
Range Resources Corp.	8.25%	01/15/2029	32	35,681	0.0
Renewable Energy Group, Inc.	5.88%	06/01/2028	129	134,203	0.1
SM Energy Co.	5.63%	06/01/2025	37	35,405	0.0
Southwestern Energy Co.	7.50%	04/01/2026	210	221,830	0.1
Southwestern Energy Co.	8.38%	09/15/2028	65	72,006	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.50%	02/15/2026	227	233,862	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	6.00%	04/15/2027	158	164,956	0.1
Talos Production, Inc.	12.00%	01/15/2026	275	280,500	0.2
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp.	4.00%	01/15/2032	369	366,005	0.2
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp.	5.50%	03/01/2030	124	133,915	0.1
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp.	6.50%	07/15/2027	145	157,164	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.	7.75%	10/15/2024	79	79,637	0.1
Transocean Pontus Ltd.	6.13%	08/01/2025	44	43,864	0.0
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	28	27,336	0.0
Transocean, Inc.	8.00%	02/01/2027	417	316,375	0.2
Transocean, Inc.	11.50%	01/30/2027	123	122,306	0.1
Weatherford International Ltd.	11.00%	12/01/2024	14	14,143	0.0
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	109	113,294	0.1
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022	73	74,664	0.0
Western Midstream Operating LP	4.35%	02/01/2025	232	242,800	0.2
Western Midstream Operating LP	4.65%	07/01/2026	165	176,530	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	34	36,545	0.0
Western Midstream Operating LP	5.30%	02/01/2030	151	166,451	0.1
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	76	78,734	0.0
				15,827,091	9.9
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	71	74,990	0.1
H&E Equipment Services, Inc.	3.88%	12/15/2028	39	37,755	0.0
Interface, Inc.	5.50%	12/01/2028	180	188,281	0.1
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025	214	218,600	0.1
Laureate Education, Inc.	8.25%	05/01/2025	19	19,784	0.0
				539,410	0.3
DIENSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.88%	07/15/2032	255	262,988	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	337	357,825	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027	275	303,216	0.2
ANGI Group LLC	3.88%	08/15/2028	221	216,911	0.1
Aptim Corp.	7.75%	06/15/2025	333	289,913	0.2
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	58	61,421	0.0
APX Group, Inc.	7.88%	12/01/2022	352	353,613	0.2
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025	63	66,953	0.0
Carriage Services, Inc.	6.63%	06/01/2026	18	18,894	0.0
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	397	421,674	0.3
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023	EUR 114	138,257	0.1
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	USD 60	60,175	0.0
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027	207	229,074	0.2
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028	314	318,580	0.2
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	447	444,714	0.3
Nielsen Co. Luxembourg SARL (The)	5.00%	02/01/2025	368	377,974	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	3.38%	08/31/2027	USD 284	\$ 272,792	0.2%
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	137	145,915	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	70	76,503	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	358	369,930	0.2
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025	46	47,383	0.0
Sabre GBLB, Inc.	7.38%	09/01/2025	90	97,070	0.1
Sabre GBLB, Inc.	9.25%	04/15/2025	90	105,365	0.1
Service Corp. International/US	3.38%	08/15/2030	283	274,773	0.2
Square, Inc.	2.75%	06/01/2026	233	234,864	0.2
Square, Inc.	3.50%	06/01/2031	319	319,092	0.2
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	207	223,022	0.1
Verisure Holding AB	3.25%	02/15/2027	EUR 181	222,492	0.1
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	181	227,353	0.1
Verscend Escrow Corp.	9.75%	08/15/2026	USD 242	256,676	0.2
				<u>6,795,412</u>	<u>4.3</u>
TECHNOLOGIE					
Ahead DB Holdings LLC	6.63%	05/01/2028	95	96,296	0.1
Ascend Learning LLC	6.88%	08/01/2025	28	28,578	0.0
Austin BidCo, Inc.	7.13%	12/15/2028	124	123,930	0.1
Avaya, Inc.	6.13%	09/15/2028	340	360,681	0.2
Banff Merger Sub, Inc.	9.75%	09/01/2026	250	264,772	0.2
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	181	193,963	0.1
Cablevision Lightpath LLC	5.63%	09/15/2028	330	332,756	0.2
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024	83	85,518	0.1
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	121	127,233	0.1
CommScope, Inc.	8.25%	03/01/2027	73	77,943	0.0
Exela Intermediate LLC/Exela Finance, Inc.	10.00%	07/15/2023	28	9,711	0.0
Imola Merger Corp.	4.75%	05/15/2029	153	154,558	0.1
LogMeIn, Inc.	5.50%	09/01/2027	72	74,299	0.0
Microchip Technology, Inc.	4.25%	09/01/2025	600	629,723	0.4
NCR Corp.	5.13%	04/15/2029	491	503,643	0.3
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	89	93,709	0.1
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	133	144,410	0.1
NCR Corp.	8.13%	04/15/2025	97	105,687	0.1
Pitney Bowes, Inc.	6.88%	03/15/2027	151	156,650	0.1
Playtika Holding Corp.	4.25%	03/15/2029	381	375,534	0.2
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	15	15,412	0.0
Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028	13	14,162	0.0
Rackspace Technology Global, Inc.	3.50%	02/15/2028	416	400,425	0.3
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	42	43,580	0.0
Sensata Technologies, Inc.	3.75%	02/15/2031	277	270,933	0.2
Solera LLC/Solera Finance, Inc.	10.50%	03/01/2024	448	459,943	0.3
TTM Technologies, Inc.	4.00%	03/01/2029	152	150,626	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	959	992,976	0.6
				<u>6,287,651</u>	<u>4.0</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	230	242,945	0.2
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	202	216,131	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	242	256,911	0.2
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	237	268,208	0.2
United Airlines, Inc.	4.63%	04/15/2029	226	234,055	0.1
				<u>1,218,250</u>	<u>0.8</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	168	174,715	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	26	27,292	0.0
Herc Holdings, Inc.	5.50%	07/15/2027	48	50,575	0.1
Modulaire Global Finance PLC	6.50%	02/15/2023	EUR 100	123,952	0.1
Modulaire Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023	USD 200	203,807	0.1
United Rentals North America, Inc.	3.88%	02/15/2031	510	512,758	0.3
United Rentals North America, Inc.	5.88%	09/15/2026	145	150,848	0.1
XPO Logistics, Inc.	6.13%	09/01/2023	39	39,414	0.0
XPO Logistics, Inc.	6.75%	08/15/2024	163	170,450	0.1
				<u>1,453,811</u>	<u>0.9</u>
				<u>109,058,246</u>	<u>68.5</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Alliance Data Systems Corp.	4.75%	12/15/2024	333	343,193	0.2
Alliance Data Systems Corp.	7.00%	01/15/2026	58	62,277	0.0
Ally Financial, Inc., Series B(d)	4.70%	05/15/2026	419	430,427	0.3
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(d)	5.88%	05/24/2022	EUR 200	254,256	0.2
Banco Santander SA(d)	5.25%	09/29/2023	400	515,415	0.3
CaixaBank SA(d)	5.88%	10/09/2027	200	278,775	0.2

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
	Discover Financial Services, Series D(d)	6.13%	06/23/2025	USD 304	\$ 340,972	0.2%
	Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	200	218,011	0.1
	Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	424	479,975	0.3
					<u>2,923,301</u>	<u>1.8</u>
MAKLER	LPL Holdings, Inc.	4.00%	03/15/2029	228	226,639	0.2
	NFP Corp.	6.88%	08/15/2028	129	133,445	0.1
	NFP Corp.	7.00%	05/15/2025	60	65,774	0.0
					<u>425,858</u>	<u>0.3</u>
FINANZEN	CNG Holdings, Inc.	12.50%	06/15/2024	108	102,284	0.1
	Compass Group Diversified Holdings LLC	5.25%	04/15/2029	137	141,296	0.1
	Curo Group Holdings Corp.	8.25%	09/01/2025	270	276,681	0.2
	Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	499	518,798	0.3
	goeasy Ltd.	4.38%	05/01/2026	232	235,053	0.1
	Hightower Holding LLC	6.75%	04/15/2029	495	502,273	0.3
	Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR 100	123,482	0.1
	Navient Corp.	5.50%	01/25/2023	USD 453	475,179	0.3
	Navient Corp.	6.50%	06/15/2022	43	45,023	0.0
	Navient Corp.	6.75%	06/15/2026	90	98,783	0.1
	OneMain Finance Corp.	8.88%	06/01/2025	183	201,770	0.1
	SLM Corp.	4.20%	10/29/2025	271	287,217	0.2
	SLM Corp.	5.13%	04/05/2022	54	55,165	0.0
					<u>3,063,004</u>	<u>1.9</u>
VERSICHERUNGEN	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	7.00%	11/15/2025	298	304,705	0.2
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	10.13%	08/01/2026	46	51,830	0.0
	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer.	6.75%	10/15/2027	338	348,725	0.2
	AmWINS Group, Inc.	7.75%	07/01/2026	224	238,228	0.2
	Ardonagh Midco 2 PLC(a)	11.50%	01/15/2027	392	421,470	0.3
	AssuredPartners, Inc.	5.63%	01/15/2029	362	360,956	0.2
	AssuredPartners, Inc.	7.00%	08/15/2025	27	27,565	0.0
	HUB International Ltd.	7.00%	05/01/2026	54	55,964	0.1
	USI, Inc./NY	6.88%	05/01/2025	13	13,235	0.0
					<u>1,822,678</u>	<u>1.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE	Altice France Holding SA	10.50%	05/15/2027	EUR 300	335,343	0.2
	Intrum AB	2.75%	07/15/2022	11	13,536	0.0
	Intrum AB	3.50%	07/15/2026	241	297,621	0.2
					<u>646,500</u>	<u>0.4</u>
REITS	Aedas Homes Opco SI	4.00%	08/15/2026	202	250,788	0.1
	Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	USD 644	676,203	0.4
	Diversified Healthcare Trust	4.75%	02/15/2028	264	255,044	0.2
	Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	390	432,953	0.3
	Iron Mountain, Inc.	4.50%	02/15/2031	265	264,208	0.2
	Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	116	119,996	0.1
	Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	15	15,678	0.0
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.63%	05/01/2024	256	275,546	0.2
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.75%	02/01/2027	138	153,258	0.1
	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/ PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	213	220,815	0.1
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	4.88%	06/01/2023	105	109,202	0.1
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	5.75%	01/15/2029	85	88,848	0.1
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	9.38%	04/01/2027	349	388,687	0.2
	Via Celere Desarrollos	5.25%	04/01/2026	EUR 189	238,586	0.1
					<u>3,489,812</u>	<u>2.2</u>
					<u>12,371,153</u>	<u>7.8</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT	Calpine Corp.	3.75%	03/01/2031	USD 682	644,383	0.4
	NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027	36	37,353	0.0
	NRG Energy, Inc.	7.25%	05/15/2026	116	120,424	0.1
	Talen Energy Supply LLC	6.50%	06/01/2025	158	133,030	0.1
	Talen Energy Supply LLC	7.25%	05/15/2027	204	208,513	0.1
	Talen Energy Supply LLC	10.50%	01/15/2026	52	47,320	0.0
	Vistra Operations Co. LLC	4.38%	05/01/2029	457	459,524	0.3
	Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	272	282,718	0.2
					<u>1,933,265</u>	<u>1.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	USD 278	\$ 291,213	0.2%
				2,224,478	1.4
				123,653,877	77.7
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	146	202,074	0.1
Bank of America Corp., Series X(d)	6.25%	09/05/2024	43	47,730	0.0
Bank of America Corp., Series Z(d)	6.50%	10/23/2024	30	34,116	0.0
BNP Paribas SA(d)	7.38%	08/19/2025	347	403,428	0.2
CIT Group, Inc.	3.93%	06/19/2024	207	219,209	0.1
CIT Group, Inc.	4.75%	02/16/2024	81	88,115	0.1
Citigroup, Inc., Series T(d)	6.25%	08/15/2026	59	68,624	0.0
Citigroup, Inc., Series U(d)	5.00%	09/12/2024	110	115,026	0.1
Citigroup, Inc., Series V(d)	4.70%	01/30/2025	117	120,168	0.1
Citigroup, Inc., Series W(d)	4.00%	12/10/2025	123	125,424	0.1
Cooperatieve Rabobank UA(d)	3.25%	12/29/2026	EUR 200	250,703	0.2
Danske Bank A/S, Series E(d)	5.88%	04/06/2022	200	253,070	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(d)	5.00%	11/10/2022	USD 101	101,557	0.1
HSBC Holdings PLC(d)	6.38%	03/30/2025	350	387,625	0.2
ING Groep NV(d)	6.50%	04/16/2025	300	333,363	0.2
JPMorgan Chase & Co., Series FF(d)	5.00%	08/01/2024	274	286,784	0.2
JPMorgan Chase & Co., Series HH(d)	4.60%	02/01/2025	136	138,583	0.1
Natwest Group PLC, Series U(d) (e)	2.52%	09/30/2027	200	198,623	0.1
Nordea Bank Abp(d)	6.63%	03/26/2026	200	229,774	0.1
Standard Chartered PLC(d) (e)	1.70%	01/30/2027	200	192,098	0.1
UniCredit SpA(d)	7.50%	06/03/2026	EUR 200	286,235	0.2
Wells Fargo & Co., Series BB(d)	3.90%	03/15/2026	USD 140	143,584	0.1
Wells Fargo & Co., Series S(d)	5.90%	06/15/2024	250	268,451	0.2
				4,494,364	2.8
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(d)	5.38%	06/01/2025	181	200,223	0.1
FINANZEN					
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	12	11,801	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	449	500,249	0.3
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	8	7,962	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	52	54,445	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	2	2,151	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	125	134,253	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	14	15,463	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	125	140,974	0.1
				867,298	0.5
VERSICHERUNGEN					
ACE Capital Trust II	9.70%	04/01/2030	90	136,259	0.1
Centene Corp.	2.50%	03/01/2031	1,265	1,211,875	0.8
Centene Corp.	4.63%	12/15/2029	6	6,490	0.0
Centene Corp.	5.38%	08/15/2026	226	236,430	0.1
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	87	113,218	0.1
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	15	16,115	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	36	38,914	0.0
				1,759,301	1.1
REITS					
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.25%	08/01/2026	75	77,321	0.0
Office Properties Income Trust	4.50%	02/01/2025	83	89,744	0.1
Sabra Health Care LP	5.13%	08/15/2026	84	94,318	0.1
Vornado Realty LP	3.40%	06/01/2031	148	149,622	0.1
				411,005	0.3
				7,732,191	4.8
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ArcelorMittal SA	7.25%	10/15/2039	302	415,159	0.3
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	44	46,965	0.0
Glencore Finance Canada Ltd.	6.00%	11/15/2041	14	18,035	0.0
				480,159	0.3
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co., Series D(d) (e)	3.51%	09/15/2021	54	51,760	0.0
Howmet Aerospace, Inc.	5.90%	02/01/2027	6	6,963	0.0
				58,723	0.0
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Hughes Satellite Systems Corp.	5.25%	08/01/2026	117	130,174	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	USD 298	\$ 325,590	0.2%
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc.	3.30%	02/15/2026	372	373,280	0.2
Marriott International, Inc./MD, Series EE	5.75%	05/01/2025	48	55,716	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	288	366,038	0.2
PulteGroup, Inc.	6.00%	02/15/2035	133	170,581	0.1
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	266	346,678	0.2
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	44	62,444	0.1
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/06/2031	200	203,685	0.1
Toll Brothers Finance Corp.	4.35%	02/15/2028	200	218,335	0.2
Toll Brothers Finance Corp.	4.88%	03/15/2027	112	126,839	0.1
				<u>1,923,596</u>	<u>1.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Kraft Heinz Foods Co.	4.25%	03/01/2031	360	401,074	0.3
Kraft Heinz Foods Co.	4.38%	06/01/2046	318	340,907	0.2
				<u>741,981</u>	<u>0.5</u>
ENERGIE					
Boardwalk Pipelines LP.	4.45%	07/15/2027	45	51,182	0.0
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	6	7,909	0.0
Continental Resources, Inc./OK	4.90%	06/01/2044	52	56,535	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	90	105,567	0.1
Enable Midstream Partners LP	3.90%	05/15/2024	366	391,749	0.2
Enable Midstream Partners LP	4.40%	03/15/2027	87	96,202	0.1
Enable Midstream Partners LP	4.95%	05/15/2028	18	20,414	0.0
Energy Transfer LP	3.90%	07/15/2026	9	9,846	0.0
Hess Corp.	7.13%	03/15/2033	18	24,078	0.0
National Oilwell Varco, Inc.	3.60%	12/01/2029	283	294,901	0.2
ONEOK, Inc.	4.55%	07/15/2028	32	36,170	0.0
Ovintiv Exploration, Inc.	5.63%	07/01/2024	269	299,088	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	75	84,046	0.1
WPX Energy, Inc.	4.50%	01/15/2030	135	145,886	0.1
				<u>1,623,573</u>	<u>1.0</u>
Dienstleistungen					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	15	17,491	0.0
Technologie					
CDW LLC/CDW Finance Corp.	4.13%	05/01/2025	242	252,964	0.2
Ingram Micro, Inc.	5.45%	12/15/2024	43	49,248	0.0
Nokia Oyj.	3.38%	06/12/2022	64	65,744	0.0
Nokia Oyj.	6.63%	05/15/2039	108	139,994	0.1
Western Digital Corp.	4.75%	02/15/2026	108	119,965	0.1
				<u>627,915</u>	<u>0.4</u>
Transportwesen – Fluggesellschaften					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	235	273,400	0.2
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	187	204,228	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	803	881,487	0.6
				<u>1,359,115</u>	<u>0.9</u>
				<u>7,288,317</u>	<u>4.6</u>
				<u>15,020,508</u>	<u>9.4</u>
Schwel lenmärkte – Industrieschuldverschreibungen					
Industrie					
Grundstoffe					
Eldorado Gold Corp.	9.50%	06/01/2024	199	216,904	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	6.88%	03/01/2026	200	208,912	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	6.88%	10/15/2027	200	218,646	0.2
				<u>644,462</u>	<u>0.4</u>
Kommunikation/Telekommunikation					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	400	426,022	0.3
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	213	224,272	0.1
				<u>650,294</u>	<u>0.4</u>
Konjunkturabhängige Konsumgüter – Sonstige					
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	203	215,688	0.1
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	223	232,114	0.2
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	436	442,649	0.3
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	200	203,413	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	243	254,670	0.2
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	312	328,033	0.2
				<u>1,676,567</u>	<u>1.1</u>
				<u>2,971,323</u>	<u>1.9</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
FINANZINSTITUTE					
VERSICHERUNGEN					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(a)	7.63%	10/15/2025	USD 264	\$ 280,114	0.2%
				<u>3,251,437</u>	<u>2.1</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB FCPI - Mortgage Income Portfolio - Class SA			13,293	1,068,755	0.7
AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT			18,694	2,172,653	1.3
				<u>3,241,408</u>	<u>2.0</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
MEXIKO					
Mexican Bonos, Series M	5.75%	03/05/2026	MXN 2,804	138,446	0.1
Mexican Bonos, Series M 20	10.00%	12/05/2024	1,800	102,316	0.1
				<u>240,762</u>	<u>0.2</u>
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Notes	1.50%	09/30/2024	USD 2,072	2,148,081	1.3
				<u>2,388,843</u>	<u>1.5</u>
STAMMAKTIE					
Avaya Holdings Corp.			4,028	115,523	0.1
Berry Corp.			18,150	115,434	0.1
Bonanza Creek Energy, Inc.			956	41,070	0.0
Denbury, Inc.			2,127	142,552	0.1
DISH Network Corp. - Class A			210	9,139	0.0
Gulfport Energy Corp.			6,137	383,562	0.2
iHeartMedia, Inc. - Class A			2,307	53,545	0.0
Ryerson Holding Corp.			4,287	70,993	0.1
SandRidge Energy, Inc.			16	85	0.0
Whiting Petroleum Corp.			2,007	91,901	0.1
				<u>1,023,804</u>	<u>0.7</u>
VORZUGSAKTIE					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Hovnanian Enterprises, Inc.	7.63%		365	7,118	0.0
ENERGIE					
Targa Resources Corp., Series A	9.50%		265	280,339	0.2
				<u>287,457</u>	<u>0.2</u>
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
DB Master Finance LLC, Series 2017-1A, Class A2I	3.63%	11/20/2047	USD 173	175,746	0.1
Taco Bell Funding LLC, Series 2016-1A, Class A23	4.97%	05/25/2046	59	63,668	0.0
Wendy's Funding LLC, Series 2018-1A, Class A2I	3.57%	03/15/2048	80	82,217	0.1
				<u>321,631</u>	<u>0.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE					
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government Bond Series 2023	7.75%	02/28/2023	ZAR 850,768	64,533	0.0
OPTIONSSCHEINE					
Avaya Holdings Corp., expiring 12/15/2022			5,308	42,464	0.0
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
CSMC Mortgage-Backed Trust, Series 2006-7, Class 3A12.	6.25%	08/25/2036	USD 4	2,487	0.0
Residential Accredited Loans, Inc. Trust, Series 2005-QA10, Class A31.	3.88%	09/25/2035	25	22,310	0.0
				<u>24,797</u>	<u>0.0</u>
NICHT STAATLICH VARIABLE VERZINSLICH					
RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-B, Class 1A4(e)	0.54%	01/25/2037	29	11,264	0.0
RISIKOTEILUNG – VARIABLE VERZINSLICH					
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities, Series 2015-C03, Class 2M2(e).	5.09%	07/25/2025	3	2,841	0.0
				<u>38,902</u>	<u>0.0</u>
				<u>149,334,864</u>	<u>93.8</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
Battalion Oil Corp.			2	25	0.0
Carlson Travel, Inc. (f)			36	0	0.0
CHC Group LLC			44,857	13,228	0.0
Paragon Offshore Ltd. - Class A (f)			455	46	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Paragon Offshore Ltd. - Class B (f)			682	\$ 6,820	0.0%
Southeastern Grocers, Inc. (f)			14,943	209,202	0.1
Vantage Drilling International			630	1,417	0.0
Willscot Corp.			1,599	46,371	0.0
ATD New Holdings, Inc. (f)			1,800	86,400	0.1
Diamond Offshore Drilling, Inc. (f)			15,330	79,078	0.1
Exide Corp. (f)			31	69,750	0.0
Monitronics International, Inc.			1,531	13,090	0.0
Monitronics International, Inc. (f)			1,269	10,850	0.0
BIS Industries Holdings Ltd. (f)			59,990	0	0.0
K201640219 South Africa Ltd. A Shares (f)			821,795	1	0.0
K201640219 South Africa Ltd. B Shares (f)			129,877	0	0.0
				<u>536,278</u>	<u>0.3</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
ENERGIE					
Vantage Drilling International(f) (g)	7.50%	11/01/2019	USD 117	<u>0</u>	<u>0.0</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.50%	10/20/2025	162	<u>173,888</u>	<u>0.1</u>
				<u>173,888</u>	<u>0.1</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Kleopatra Finco SARL.	4.25%	03/01/2026	EUR 307	<u>374,561</u>	<u>0.3</u>
Magnetation LLC/Mag Finance Corp.(f) (g)	11.00%	05/15/2018	USD 64	<u>0</u>	<u>0.0</u>
				<u>374,561</u>	<u>0.3</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	EUR 161	<u>203,766</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide Technologies, (Exchange Priority) (f)	11.00%	10/31/2024	USD 141	<u>0</u>	<u>0.0</u>
Exide Technologies, (First Lien)(f)	11.00%	10/31/2024	58	<u>0</u>	<u>0.0</u>
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Sunshine Mid BV	6.50%	05/15/2026	EUR 105	<u>132,259</u>	<u>0.1</u>
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp.(f)	6.00%	10/15/2024	USD 276	<u>0</u>	<u>0.0</u>
Gulfport Energy Corp.(f)	6.38%	05/15/2025	262	<u>0</u>	<u>0.0</u>
Gulfport Energy Corp.(f)	6.63%	05/01/2023	18	<u>0</u>	<u>0.0</u>
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
DIENTSTLEISTUNGEN					
Carlson Travel, Inc.	6.75%	12/15/2025	200	<u>172,888</u>	<u>0.1</u>
Carlson Travel, Inc.	10.50%	03/31/2025	35	<u>36,961</u>	<u>0.0</u>
Monitronics International, Inc.(f) (g)	9.13%	04/01/2020	68	<u>0</u>	<u>0.0</u>
				<u>209,849</u>	<u>0.1</u>
				<u>920,435</u>	<u>0.6</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
K2016470219 South Africa Ltd. (a) (f)	3.00%	12/31/2022	68,107	<u>0</u>	<u>0.0</u>
Tonon Luxembourg SA (a) (c) (f)	6.50%	10/31/2024	76,314	<u>771</u>	<u>0.0</u>
K2016470260 South Africa Ltd. (a) (f)	25.00%	12/31/2022	34,992	<u>0</u>	<u>0.0</u>
				<u>771</u>	<u>0.0</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	43,000	<u>44,303</u>	<u>0.0</u>
				<u>45,074</u>	<u>0.0</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
SCHATZPAPIERE					
Russian Federal Bond - OFZ Series 6217	7.50%	08/18/2021	4,866	<u>66,752</u>	<u>0.1</u>
VORZUGSAKTIE					
INDUSTRIE					
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp. (f)	0.00%		14	<u>66,500</u>	<u>0.0</u>
OPTIONSSCHEINE					
Battalion Oil Corp., expiring 10/08/2022(f)			39	<u>0</u>	<u>0.0</u>
SandRidge Energy, Inc. A-CW22, expiring 10/03/2022			7,892	<u>67</u>	<u>0.0</u>
SandRidge Energy, Inc. B-CW22, expiring 10/03/2022			3,321	<u>70</u>	<u>0.0</u>
Willscot Corp., expiring 11/29/2022(f)			2,476	<u>34,718</u>	<u>0.0</u>
				<u>34,855</u>	<u>0.0</u>
				<u>1,843,782</u>	<u>1.1</u>

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Gesamtanlagen				
(Kosten \$146,540,787).....			\$ 151,178,646	94.9%
Termineinlagen				
BNP Paribas, Paris(h)	(0.13)%	—	10,235	0.0
BNP Paribas, Paris(h)	0.00 %	—	125	0.0
BNP Paribas, Paris(h)	0.01 %	—	215	0.0
BNP Paribas, Paris(h)	2.99 %	—	9	0.0
Sumitomo, Tokyo(h)	(0.78)%	—	12,195	0.0
Sumitomo, Tokyo(h)	(0.29)%	—	14	0.0
Sumitomo, Tokyo(h)	0.01 %	—	6,460,517	4.1
Termineinlagen insgesamt			6,483,310	4.1
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			1,567,963	1.0
Nettovermögen			\$ 159,229,919	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
E-Mini Russell 2000 Index Futures	09/17/2021	1	\$ 110,090	\$ 113,255	\$ 3,165
S&P 500 E-Mini Futures	09/17/2021	2	417,555	419,250	1,695
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	122	15,083,938	15,109,891	25,953
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	15	1,976,016	1,979,063	3,047
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2021	12	1,735,500	1,739,438	(3,938)
					\$ 29,922
				Wertsteigerung	\$ 33,860
				Wertminderung	\$ (3,938)

DEVEISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	RUB 9,408	USD 127	07/28/2021	\$ (763)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 56	GBP 40	06/17/2021	1,709
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR 661	USD 45	06/17/2021	(2,791)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN 3,799	USD 188	06/18/2021	(2,379)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD 143	USD 114	07/16/2021	(4,492)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 206	USD 252	08/03/2021	(88)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 188	USD 230	08/03/2021	506
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,445	EUR 3,636	06/30/2021	(9,476)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 12,411	SEK 103,014	06/30/2021	(3,475)
HSBC Bank USA.	EUR 5,747	USD 7,050	08/03/2021	33,194
				\$ 11,945
			Wertsteigerung	\$ 35,409
			Wertminderung	\$ (23,464)

+ 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)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025	USD 608	\$ 58,683	\$ 59,284
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025	2,114	205,425	127,857
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	06/20/2026	8,256	798,383	47,549
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Ford Motor Company	06/20/2023	69	5,105	14,103
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	Ford Motor Company	06/20/2023	121	8,952	22,925
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	iTraxx Europe Crossover Series 35, 5 Year Index	06/20/2026	EUR 1,400	201,819	31,043
Insgesamt				\$ 1,278,367	\$ 302,761

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 430	06/22/2026	1.573%	3 Month LIBOR	\$ (14,325)

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 211	\$ 100,281	\$ 39,875	\$ 60,406
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	214	101,667	25,594	76,073
Verkaufskontrakte						
Credit Suisse International	International Game Technology PLC	06/20/2022	EUR 120	6,880	2,874	4,006
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 182	(51,197)	(11,988)	(39,209)
Goldman Sachs International	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	40	3,768	2,059	1,709
Goldman Sachs International	Ardagh Packaging Finance Public Ltd., Co.	12/20/2023	EUR 230	28,496	17,870	10,626
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 138	(65,621)	(23,813)	(41,808)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	447	(212,255)	(78,198)	(134,057)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	250	(70,325)	(13,778)	(56,547)
Insgesamt				\$ (158,306)	\$ (39,505)	\$ (118,801)
					Wertsteigerung	\$ 152,820
					Wertminderung	\$ (271,621)

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					
JPMorgan Chase Bank, NA.					
iBoxx \$ Liquid High Yield Index	1,730,000	LIBOR Plus 0.00%	USD 1,730	09/20/2021	\$ 33,282
Swaps insgesamt					\$ 202,917

- (a) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
(b) Wandelbares Wertpapier.
(c) Not leidend.
(d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
(e) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2021.
(f) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.
(g) Not leidendes fälliges Wertpapier.
(h) Tagesgeld.

Währungskürzel:

CAD – Canadian Dollar
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
MXN – Mexican Peso
RUB – Russian Ruble
SEK – Swedish Krona
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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Amadeus IT Group SA - Class A	525,111	\$ 39,622,960	1.1%
Automatic Data Processing, Inc.	268,805	52,691,156	1.5
Capgemini SE	227,068	42,454,866	1.2
Fidelity National Information Services, Inc.	210,816	31,407,368	0.9
Genpact Ltd.	380,456	17,402,057	0.5
Mastercard, Inc. - Class A	88,144	31,782,963	0.9
Nomura Research Institute Ltd.	469,100	14,945,872	0.4
Paychex, Inc.	661,392	66,893,187	1.9
Visa, Inc. - Class A	153,176	34,816,905	1.0
		<u>332,017,334</u>	<u>9.4</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Broadcom, Inc.	34,515	16,302,470	0.5
KLA Corp.	53,532	16,963,756	0.5
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. (Sponsored ADR)	347,120	40,738,003	1.1
Texas Instruments, Inc.	238,643	45,299,214	1.3
		<u>119,303,443</u>	<u>3.4</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	26,469	13,355,728	0.4
Citrix Systems, Inc.	359,708	41,352,031	1.2
Constellation Software, Inc./Canada	28,419	40,788,987	1.2
Microsoft Corp.	566,934	141,552,081	4.0
NortonLifeLock, Inc.	631,509	17,467,539	0.5
Oracle Corp.	880,501	69,330,649	2.0
Oracle Corp. Japan (a)	170,000	15,374,136	0.4
		<u>339,221,151</u>	<u>9.7</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	590,681	73,604,759	2.1
Logitech International SA	169,443	20,837,765	0.6
		<u>94,442,524</u>	<u>2.7</u>
		<u>884,984,452</u>	<u>25.2</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	3,971,343	31,869,342	0.9
Bank of America Corp.	324,673	13,762,888	0.4
DBS Group Holdings Ltd.	1,194,400	27,443,268	0.8
JPMorgan Chase & Co.	223,417	36,694,008	1.0
KBC Group NV	225,403	18,452,345	0.5
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	3,265,500	18,754,221	0.5
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	1,534,100	14,491,768	0.4
Royal Bank of Canada	529,027	55,011,276	1.6
Toronto-Dominion Bank (The)	413,815	29,825,646	0.9
US Bancorp	439,997	26,743,018	0.8
		<u>273,047,780</u>	<u>7.8</u>
KAPITALMÄRKTE			
CME Group, Inc. - Class A	244,226	53,426,880	1.5
Partners Group Holding AG (a)	29,607	44,687,493	1.3
S&P Global, Inc.	101,458	38,500,267	1.1
Singapore Exchange Ltd.	2,248,600	17,650,391	0.5
T. Rowe Price Group, Inc.	145,924	27,922,558	0.8
		<u>182,187,589</u>	<u>5.2</u>
VERSICHERUNGEN			
Allianz SE (REG)	65,598	17,420,303	0.5
Progressive Corp. (The)	126,666	12,550,067	0.4
RenaissanceRe Holdings Ltd.	2,638	406,569	0.0
Sampo Oyj - Class A	388,096	18,484,439	0.5
Zurich Insurance Group AG	33,467	14,076,254	0.4
		<u>62,937,632</u>	<u>1.8</u>
		<u>518,173,001</u>	<u>14.8</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	1,432,640	46,347,354	1.3
Compass Group PLC	1,624,205	37,024,562	1.1
McDonald's Corp.	66,860	15,637,885	0.4
		<u>99,009,801</u>	<u>2.8</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Garmin Ltd.	186,758	\$ 26,564,458	0.8%
Sony Group Corp.	361,900	35,986,109	1.0
		<u>62,550,567</u>	<u>1.8</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Amazon.com, Inc.	23,953	77,202,196	2.2
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Dollar General Corp.	68,308	13,863,791	0.4
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	45,603	64,145,180	1.8
Home Depot, Inc. (The)	215,123	68,604,876	2.0
O'Reilly Automotive, Inc.	46,279	24,764,818	0.7
Ross Stores, Inc.	250,576	31,670,301	0.9
		<u>189,185,175</u>	<u>5.4</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Deckers Outdoor Corp.	133,064	44,634,988	1.3
		<u>486,446,518</u>	<u>13.9</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Comcast Corp. - Class A	533,557	30,594,158	0.9
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	1,909,000	51,696,272	1.5
		<u>82,290,430</u>	<u>2.4</u>
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	372,945	36,268,901	1.0
Electronic Arts, Inc.	164,231	23,473,537	0.7
Ubisoft Entertainment SA	156,238	11,364,147	0.3
		<u>71,106,585</u>	<u>2.0</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	39,788	95,951,149	2.7
Auto Trader Group PLC	4,331,113	34,464,562	1.0
Facebook, Inc. - Class A	203,024	66,740,080	1.9
Kakaku.com, Inc.	728,000	21,667,436	0.6
		<u>218,823,227</u>	<u>6.2</u>
		<u>372,220,242</u>	<u>10.6</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	446,505	24,687,261	0.7
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	1,565,742	45,582,412	1.3
Walmart, Inc.	348,189	49,453,284	1.4
		<u>95,035,696</u>	<u>2.7</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Morinaga & Co., Ltd./Japan	440,800	13,694,389	0.4
Nestle SA (REG)	195,424	24,138,418	0.7
Salmar ASA	750,701	55,422,509	1.6
		<u>93,255,316</u>	<u>2.7</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The)	311,309	41,980,019	1.2
TABAK			
Philip Morris International, Inc.	342,213	32,999,600	0.9
Swedish Match AB	5,590,620	51,831,595	1.5
		<u>84,831,195</u>	<u>2.4</u>
		<u>339,789,487</u>	<u>9.7</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Medtronic PLC	130,332	16,498,728	0.5
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Anthem, Inc.	112,887	44,953,861	1.3
UnitedHealth Group, Inc.	173,057	71,285,639	2.0
		<u>116,239,500</u>	<u>3.3</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Thermo Fisher Scientific, Inc.	32,996	15,491,622	0.4
PHARMAZEUTIKA			
Eli Lilly & Co.	88,508	17,678,588	0.5
Johnson & Johnson	103,844	17,575,597	0.5
Merck & Co., Inc.	411,473	31,226,686	0.9

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Novo Nordisk A/S - Class B			486,410	\$ 38,400,098	1.1%
Roche Holding AG			232,031	81,222,837	2.3
				<u>186,103,806</u>	<u>5.3</u>
				<u>334,333,656</u>	<u>9.5</u>
INDUSTRIEGÜTER					
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG					
L3Harris Technologies, Inc.			107,015	23,335,691	0.7
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG					
Generac Holdings, Inc.			51,434	16,907,384	0.5
Regal Beloit Corp.			167,725	23,855,527	0.7
Schneider Electric SE (Paris)			167,577	26,671,501	0.7
				<u>67,434,412</u>	<u>1.9</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN					
Booz Allen Hamilton Holding Corp.			367,409	31,204,046	0.9
RELX PLC			1,764,267	46,228,559	1.3
Wolters Kluwer NV			349,732	33,587,201	1.0
				<u>111,019,806</u>	<u>3.2</u>
				<u>201,789,909</u>	<u>5.8</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
Enel SpA			4,166,181	41,317,303	1.2
NextEra Energy, Inc.			445,204	32,597,837	0.9
				<u>73,915,140</u>	<u>2.1</u>
MEHRFACH-VERSORGUNGSBETRIEBE					
Ameren Corp.			306,132	25,776,314	0.7
Dominion Energy, Inc.			213,719	16,272,565	0.5
				<u>42,048,879</u>	<u>1.2</u>
				<u>115,964,019</u>	<u>3.3</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Akzo Nobel NV			216,676	27,663,980	0.8
Johnson Matthey PLC			549,244	23,693,095	0.7
				<u>51,357,075</u>	<u>1.5</u>
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
American Campus Communities, Inc.			237,990	11,223,608	0.3
Nippon Building Fund, Inc.			2,698	17,250,366	0.5
				<u>28,473,974</u>	<u>0.8</u>
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Vonovia SE			224,821	14,111,850	0.4
				<u>42,585,824</u>	<u>1.2</u>
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Royal Dutch Shell PLC - Class B			2,251,583	40,936,586	1.2
Gesamtanlagen				<u>\$ 3,388,580,769</u>	<u>96.7%</u>
Termineinlagen					
Bank of Nova Scotia, Toronto(b)	0.01 %	—		3,128,301	0.1
BNP Paribas, Paris(b)	(0.53)%	—		679,436	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.13)%	—		550,446	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.00 %	—		609,448	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.01 %	—		371	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	2.99 %	—		1,047	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.44)%	—		347,691	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	—		948,076	0.1
JPMorgan Chase, New York(b)	0.01 %	—		59,289,461	1.7
Nordea Bank Abp, Oslo(b)	(0.78)%	—		1,938,439	0.1
Nordea Bank Abp, Oslo(b)	(0.13)%	—		349,974	0.0
SEB, Stockholm(b)	(0.28)%	—		350,452	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.29)%	—		427,875	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	0.01 %	—		503,130	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>69,124,147</u>	<u>2.0</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>46,680,948</u>	<u>1.3</u>
Nettovermögen				<u>\$ 3,504,385,864</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	USD	17,528	GBP	12,569	06/17/2021	\$ 309,763
Bank of America, NA.	NOK	351,759	USD	41,370	07/15/2021	(693,974)
Bank of America, NA.	JPY	1,333,421	USD	12,251	08/19/2021	103,458
Barclays Bank PLC.	USD	26,886	AUD	35,316	06/04/2021	339,540
Barclays Bank PLC.	GBP	5,703	USD	7,944	06/17/2021	(150,033)
BNP Paribas SA.	SGD	51,833	USD	38,879	08/19/2021	(306,379)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	28,999	USD	39,959	06/17/2021	(1,195,120)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	6,887	GBP	4,955	06/17/2021	144,659
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	155,103	AUD	198,476	06/07/2021	(2,096,115)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	20,241	CAD	24,656	06/07/2021	168,558
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	16,124	CNH	104,845	06/07/2021	334,458
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	77,384	EUR	63,748	06/07/2021	360,310
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	243,059	SGD	322,940	06/07/2021	1,126,953
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	20,241	CAD	24,465	06/21/2021	10,101
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2,706	ZAR	38,199	06/21/2021	58,549
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	86,619	GBP	61,226	06/30/2021	273,751
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	31,025	NZD	42,510	06/30/2021	(232,582)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	118	PLN	435	06/30/2021	107
Goldman Sachs Bank USA.	TWD	984,199	USD	35,090	07/22/2021	(681,901)
Goldman Sachs Bank USA.	USD	59,116	JPY	6,433,530	08/19/2021	(505,727)
HSBC Bank USA.	ILS	55,156	USD	16,723	06/23/2021	(255,435)
JPMorgan Chase Bank, NA.	USD	14,372	GBP	10,153	06/17/2021	36,964
Morgan Stanley Capital Services LLC.	USD	6,936	GBP	4,982	06/17/2021	134,711
Morgan Stanley Capital Services LLC.	SEK	82,400	USD	9,854	07/15/2021	(72,607)
Morgan Stanley Capital Services LLC.	CHF	69,047	USD	75,856	08/05/2021	(1,034,506)
Morgan Stanley Capital Services LLC.	JPY	567,889	USD	5,217	08/19/2021	43,337
Morgan Stanley Capital Services LLC.	USD	8,752	HKD	67,920	08/19/2021	795
Royal Bank of Scotland PLC.	USD	19,474	HKD	151,196	08/19/2021	11,145
						\$ (3,767,220)
					Wertsteigerung	\$ 3,457,159
					Wertminderung	\$ (7,224,379)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

Währungskürzel:

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

Glossar:

REG – Registered Shares
REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Lotes Co., Ltd.	510,000	\$ 10,867,325	1.1%
Simplo Technology Co., Ltd.	921,000	12,105,572	1.2
Sinbon Electronics Co., Ltd.	1,227,000	11,564,967	1.2
		<u>34,537,864</u>	<u>3.5</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
HCL Technologies Ltd.	642,013	8,343,485	0.8
Infosys Ltd. (Sponsored ADR)	1,893,770	36,625,512	3.7
Tata Consultancy Services Ltd.	351,868	15,252,184	1.6
WNS Holdings Ltd. (ADR)	168,180	12,529,410	1.3
		<u>72,750,591</u>	<u>7.4</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Novatek Microelectronics Corp.	1,091,000	19,813,270	2.0
Parade Technologies Ltd.	124,000	6,699,850	0.7
Realtek Semiconductor Corp.	822,000	14,710,200	1.5
SK Hynix, Inc.	27,670	3,102,391	0.3
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	4,719,000	100,194,685	10.2
United Microelectronics Corp.	3,502,000	6,581,561	0.7
		<u>151,101,957</u>	<u>15.4</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Advantech Co., Ltd.	620,913	7,315,958	0.8
Samsung Electronics Co., Ltd.	716,540	51,433,416	5.2
Samsung Electronics Co., Ltd. (Preference Shares)	109,690	7,096,455	0.7
		<u>65,845,829</u>	<u>6.7</u>
		<u>324,236,241</u>	<u>33.0</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Fu Shou Yuan International Group Ltd.	8,544,500	9,166,114	0.9
New Oriental Education & Technology Group, Inc.	267,300	2,707,414	0.3
New Oriental Education & Technology Group, Inc. (Sponsored ADR)	267,300	2,734,479	0.3
		<u>14,608,007</u>	<u>1.5</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Bear Electric Appliance Co., Ltd.	282,345	3,183,816	0.3
Midea Group Co., Ltd. - Class A	809,713	10,520,998	1.1
Nien Made Enterprise Co., Ltd.	649,000	9,545,322	1.0
		<u>23,250,136</u>	<u>2.4</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	934,600	24,996,357	2.5
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	206,220	44,122,831	4.5
JD.com, Inc. (ADR)	106,330	7,862,040	0.8
JD.com, Inc. - Class A	84,600	3,119,609	0.3
		<u>80,100,837</u>	<u>8.1</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Topsports International Holdings Ltd.	9,049,495	14,006,067	1.4
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	907,500	7,547,967	0.8
		<u>21,554,034</u>	<u>2.2</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
ANTA Sports Products Ltd.	284,000	5,732,894	0.6
Feng TAY Enterprise Co., Ltd.	1,052,200	9,290,796	0.9
Hermes International	3,080	4,291,190	0.4
LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton SE	10,230	8,194,566	0.8
Moncler SpA	80,449	5,683,527	0.6
Shenzhen International Group Holdings Ltd.	514,000	13,549,259	1.4
		<u>46,742,232</u>	<u>4.7</u>
		<u>186,255,246</u>	<u>18.9</u>
KOMMUNIKATIONS-DIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
NCSoft Corp.	27,480	20,999,072	2.1
NetEase, Inc.	272,600	6,403,641	0.7
NetEase, Inc. (ADR)	113,520	13,387,414	1.4
		<u>40,790,127</u>	<u>4.2</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Tencent Holdings Ltd.	1,161,900	90,838,399	9.2
		<u>131,628,526</u>	<u>13.4</u>

		Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
FINANZWERTE				
BANKEN				
	Bank Central Asia Tbk PT	2,582,000	\$ 5,726,192	0.6%
	CTBC Financial Holding Co., Ltd.	13,401,000	11,100,792	1.1
	Grupo Financiero Banorte SAB de CV - Class O	438,290	2,989,561	0.3
	HDFC Bank Ltd.	790,626	16,401,116	1.7
	Shinhan Financial Group Co., Ltd.	275,190	10,441,240	1.0
			<u>46,658,901</u>	<u>4.7</u>
KAPITALMÄRKTE				
	B3 SA - Brasil Bolsa Balcao	894,900	3,001,487	0.3
VERSICHERUNGEN				
	AIA Group Ltd.	1,492,400	19,918,038	2.0
	BB Seguridade Participacoes SA	1,226,100	5,502,711	0.6
	Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	2,632,500	28,755,259	2.9
			<u>54,176,008</u>	<u>5.5</u>
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG				
	Housing Development Finance Corp., Ltd.	240,485	8,420,725	0.9
			<u>112,257,121</u>	<u>11.4</u>
VERBRAUCHSGÜTER				
GETRÄNKE				
	Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A	29,706	10,425,347	1.1
	Pernod Ricard SA	55,200	12,186,759	1.2
			<u>22,612,106</u>	<u>2.3</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL				
	Wal-Mart de Mexico SAB de CV	4,952,900	15,812,577	1.6
LEBENSMITTELPRODUKTE				
	Nestle SA (REG)	219,160	27,070,246	2.8
	Uni-President Enterprises Corp.	903,000	2,369,094	0.2
			<u>29,439,340</u>	<u>3.0</u>
HAUSHALTSPRODUKTE				
	Colgate-Palmolive Co.	263,470	22,073,517	2.2
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE				
	LG Household & Health Care Ltd.	4,830	6,621,055	0.7
			<u>96,558,595</u>	<u>9.8</u>
VERSORGUNG				
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE				
	Cia de Transmissao de Energia Eletrica Paulista (Preference Shares)	1,840,600	9,305,948	0.9
	Transmissora Alianca de Energia Eletrica SA	481,900	3,606,136	0.4
			<u>12,912,084</u>	<u>1.3</u>
GASVERSORGUNGSBETRIEBE				
	China Resources Gas Group Ltd.	1,812,000	11,235,514	1.1
	ENN Energy Holdings Ltd.	1,116,000	20,515,973	2.1
			<u>31,751,487</u>	<u>3.2</u>
WASSERVERSORGER				
	Guangdong Investment Ltd.	6,970,000	10,386,938	1.1
			<u>55,050,509</u>	<u>5.6</u>
IMMOBILIEN				
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG				
	Country Garden Services Holdings Co., Ltd.	996,000	10,106,605	1.0
INDUSTRIEGÜTER				
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG				
	NARI Technology Co., Ltd.	1,087,500	5,182,452	0.5
ENERGIE				
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE				
	LUKOIL PJSC (Sponsored ADR)	62,036	5,037,944	0.5
Gesamtanlagen				
	(Kosten \$636,884,777)		<u>\$926,313,239</u>	<u>94.1%</u>

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Termineinlagen				
BNP Paribas, Paris(a)	0.00 %	—	\$ 10	0.0%
BNP Paribas, Paris(a)	2.99 %	—	170,733	0.1
Credit Suisse AG, Zurich(a)	(1.44)%	—	99,011	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(a)	(0.78)%	—	169,474	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(a)	0.00 %	—	113,093	0.0
Nordea Bank Abp, Oslo(a)	(0.13)%	—	163,419	0.0
Sumitomo, Tokyo(a)	(0.29)%	—	638	0.0
Sumitomo, Tokyo(a)	0.01 %	—	53,895,998	5.5
Termineinlagen insgesamt			54,612,376	5.6
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			3,312,663	0.3
Nettovermögen			\$984,238,278	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	84	AUD	108 06/30/2021	\$ (523)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	66	CAD	80 06/30/2021	189
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	24	EUR	20 06/30/2021	(52)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	22	GBP	16 06/30/2021	71
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	11	NZD	15 06/30/2021	(81)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	24	SGD	32 06/30/2021	39
					\$ (357)
				Wertsteigerung	\$ 299
				Wertminderung	\$ (656)

+ 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 GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Alpek SAB de CV	3.25%	02/25/2031	USD 367	£ 258,282	0.0%
AngloGold Ashanti Holdings PLC	3.75%	10/01/2030	338	246,507	0.0
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024	2,030	1,558,100	0.2
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	1,028	788,408	0.1
Smurfit Kappa Acquisitions ULC	2.75%	02/01/2025	EUR 2,245	2,095,929	0.3
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	USD 422	308,442	0.0
				<u>5,255,668</u>	<u>0.6</u>
INVESTITIONSGÜTER					
BAE Systems PLC	4.13%	06/08/2022	GBP 3,230	3,345,842	0.4
Caterpillar Financial Services Corp.(a)	0.67%	05/15/2023	USD 700	496,984	0.1
CNH Industrial Finance Europe SA, Series G	2.88%	05/17/2023	EUR 2,085	1,894,267	0.2
Dover Corp.	0.75%	11/04/2027	1,393	1,220,626	0.2
General Electric Co.	0.88%	05/17/2025	1,900	1,674,260	0.2
General Electric Co.	1.88%	05/28/2027	129	119,431	0.0
Johnson Controls International PLC	1.00%	09/15/2023	4,809	4,230,047	0.5
Wabtec Transportation Netherlands BV.	1.25%	12/03/2027	1,040	895,003	0.1
				<u>13,876,460</u>	<u>1.7</u>
KOMMUNIKATIONS MEDIEN					
Discovery Communications LLC	4.13%	05/15/2029	USD 2,585	2,008,896	0.2
Prosus NV	3.68%	01/21/2030	2,198	1,636,516	0.2
Sky Ltd.	1.88%	11/24/2023	EUR 3,150	2,846,634	0.4
Weibo Corp.	3.38%	07/08/2030	USD 1,715	1,222,592	0.2
				<u>7,714,638</u>	<u>1.0</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	5.50%	03/15/2027	GBP 2,500	3,060,889	0.4
AT&T, Inc., Series B(b)	2.88%	03/02/2025	EUR 600	520,725	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	USD 1,570	1,718,971	0.2
CK Hutchison Group Telecom Finance SA	0.38%	10/17/2023	EUR 2,019	1,749,268	0.2
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025	USD 3,220	2,434,026	0.3
Verizon Communications, Inc.(a)	1.26%	02/17/2023	AUD 2,050	1,123,403	0.1
				<u>10,607,282</u>	<u>1.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
American Honda Finance Corp.	2.63%	10/14/2022	GBP 2,834	2,915,418	0.4
BMW US Capital LLC(a)	0.66%	08/13/2021	USD 1,200	846,404	0.1
Daimler International Finance BV	1.50%	08/18/2021	GBP 2,200	2,204,846	0.3
Dongfeng Motor Hong Kong International Co., Ltd.	1.15%	10/23/2021	EUR 1,191	1,027,435	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	0.90%	11/19/2024	2,277	1,995,995	0.2
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	USD 1,571	1,183,047	0.1
Hyundai Capital America	2.85%	11/01/2022	1,695	1,231,159	0.2
Hyundai Capital Services, Inc.	3.50%	06/03/2021	AUD 920	500,155	0.1
Hyundai Capital Services, Inc.	3.50%	03/30/2022	1,435	796,708	0.1
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027	USD 1,334	1,036,809	0.1
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	669	515,053	0.1
Toyota Motor Finance Netherlands BV	1.38%	05/23/2023	GBP 1,780	1,811,543	0.2
Volkswagen Leasing GmbH.	1.13%	04/04/2024	EUR 3,595	3,186,752	0.4
				<u>19,251,324</u>	<u>2.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Las Vegas Sands Corp.	3.20%	08/08/2024	USD 2,785	2,064,218	0.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1.00%	02/11/2023	GBP 2,800	2,823,732	0.3
PVH Corp.	3.63%	07/15/2024	EUR 2,275	2,144,737	0.3
				<u>4,968,469</u>	<u>0.6</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Abbott Ireland Financing DAC	0.88%	09/27/2023	2,033	1,791,745	0.2
AbbVie, Inc.	1.38%	05/17/2024	2,125	1,895,819	0.2
AbbVie, Inc., Series WI(c)	1.25%	06/01/2024	2,455	2,183,205	0.3
Altria Group, Inc.	3.13%	06/15/2031	1,920	1,871,681	0.2
Anheuser-Busch InBev SA/NV	9.75%	07/30/2024	GBP 2,735	3,493,858	0.5
Asahi Group Holdings Ltd.	0.16%	10/23/2024	EUR 4,675	4,034,027	0.5
AstraZeneca PLC(a)	0.80%	06/10/2022	USD 873	618,271	0.1
AstraZeneca PLC(a)	0.82%	08/17/2023	2,238	1,592,320	0.2
BAT Capital Corp.	4.70%	04/02/2027	2,821	2,241,467	0.3
Baxter International, Inc.	0.40%	05/15/2024	EUR 2,616	2,282,620	0.3
Bayer AG	0.38%	07/06/2024	2,800	2,430,291	0.3
Bayer US Finance II LLC(a)	0.83%	06/25/2021	USD 1,500	1,057,428	0.1
CVS Health Corp.	5.05%	03/25/2048	1,147	1,003,898	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover- mögen %
Heineken NV	3.40%	04/01/2022	USD 1,043	£ 753,324	0.1%
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	1.13%	11/21/2022	EUR 4,315	3,780,991	0.5
Wm Morrison Supermarkets PLC	3.50%	07/27/2026	GBP 2,695	2,996,565	0.4
				<u>34,027,510</u>	<u>4.3</u>
ENERGIE					
Boardwalk Pipelines LP.	4.45%	07/15/2027	USD 1,890	1,514,728	0.2
BP Capital Markets PLC(b)	3.63%	03/22/2029	EUR 2,125	1,956,065	0.2
Cenovus Energy, Inc.	4.40%	04/15/2029	USD 1,779	1,396,893	0.2
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	397	319,302	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	09/18/2023	2,520	1,917,768	0.2
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	1,826	1,316,064	0.2
Energy Transfer LP	6.25%	04/15/2049	2,220	1,960,531	0.2
Eni SpA	4.25%	05/09/2029	739	586,882	0.1
Eni SpA, Series NC9(b)	2.75%	02/11/2030	EUR 1,463	1,247,591	0.2
Eni SpA, Series NC9(b)	3.38%	07/13/2029	711	640,189	0.1
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR 90,000	871,051	0.1
Kinder Morgan, Inc.(a)	1.46%	01/15/2023	USD 2,950	2,106,453	0.3
ONEOK, Inc.	4.00%	07/13/2027	2,235	1,742,267	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.55%	12/15/2029	174	127,246	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.80%	09/15/2030	1,669	1,236,967	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	305	240,841	0.0
Suncor Energy, Inc.	6.50%	06/15/2038	861	833,274	0.1
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	2,309	1,759,459	0.2
Total Capital International SA	1.66%	07/22/2026	GBP 2,900	2,985,281	0.4
TOTAL SE, Series NC7(b)	1.63%	10/25/2027	EUR 1,199	1,025,128	0.1
Valero Energy Corp.	6.63%	06/15/2037	USD 438	410,471	0.1
				<u>26,194,451</u>	<u>3.3</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
CK Hutchison Finance 16 Ltd., Series A	1.25%	04/06/2023	EUR 3,680	3,237,801	0.4
DIENTSTLEISTUNGEN					
eBay, Inc.(a)	1.06%	01/30/2023	USD 385	274,054	0.0
IHS Markit Ltd.	4.25%	05/01/2029	371	297,971	0.1
IHS Markit Ltd.	4.75%	08/01/2028	51	41,901	0.0
				<u>613,926</u>	<u>0.1</u>
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.88%	09/29/2023	2,500	1,875,903	0.2
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	3.50%	01/15/2028	57	43,131	0.0
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	3.88%	01/15/2027	153	118,565	0.0
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028	2,290	1,786,547	0.2
Fidelity National Information Services, Inc.	0.63%	12/03/2025	EUR 307	269,229	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	0.75%	05/21/2023	2,190	1,912,073	0.3
Fidelity National Information Services, Inc.	1.00%	12/03/2028	207	182,244	0.0
Fiserv, Inc.	0.38%	07/01/2023	1,770	1,535,285	0.2
Fiserv, Inc.	1.13%	07/01/2027	1,236	1,106,875	0.2
Hewlett Packard Enterprise Co.(a)	0.91%	10/05/2021	USD 1,132	797,540	0.1
				<u>9,627,392</u>	<u>1.2</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	1,017	833,725	0.1
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Pacific National Finance Pty Ltd.	5.00%	09/19/2023	GBP 2,780	3,000,482	0.4
TRANSPORTWESEN – DIENTSTLEISTUNGEN					
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	USD 2,265	1,680,615	0.2
				<u>142,953,961</u>	<u>17.9</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	1.25%	05/28/2025	EUR 3,600	3,228,038	0.4
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	4.40%	05/19/2026	USD 2,460	1,959,900	0.2
Banco Santander SA	2.75%	09/12/2023	GBP 2,000	2,088,090	0.3
Bank Of America Corp.	0.58%	08/24/2028	EUR 4,530	3,908,031	0.5
Bank of Nova Scotia (The)	1.38%	12/05/2023	GBP 1,781	1,813,281	0.2
Barclays PLC	3.13%	01/17/2024	1,890	1,994,654	0.3
BNP Paribas SA	1.88%	12/14/2027	1,900	1,931,416	0.2
BNP Paribas SA(b)	6.75%	03/14/2022	USD 2,705	1,975,466	0.2
BPCE SA(a)	1.42%	09/12/2023	4,995	3,593,071	0.5
CaixaBank SA	1.00%	06/25/2024	EUR 2,700	2,380,169	0.3
Citigroup, Inc.	1.25%	07/06/2026	2,155	1,931,612	0.2
Citigroup, Inc.	1.50%	07/24/2026	2,185	1,975,348	0.2
Cooperatieve Rabobank UA(b)	4.38%	06/29/2027	1,400	1,322,960	0.2
Cooperatieve Rabobank UA	5.25%	09/14/2027	GBP 1,595	1,915,921	0.2
Credit Agricole SA(b)	7.88%	01/23/2024	USD 2,595	2,064,801	0.3
Credit Suisse Group AG	2.13%	09/12/2025	GBP 797	818,809	0.1
Danske Bank A/S	2.25%	01/14/2028	1,875	1,919,535	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover- mögen %
Danske Bank A/S	3.24%	12/20/2025	USD 998	£ 752,822	0.1%
Danske Bank A/S	5.38%	01/12/2024	203	159,520	0.0
DNB Bank ASA(b)	6.50%	03/26/2022	3,000	2,197,236	0.3
Erste Group Bank AG(b)	8.88%	10/15/2021	EUR 1,800	1,596,379	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	7.13%	08/07/2025	GBP 2,845	3,541,070	0.4
HSBC Holdings PLC	3.00%	07/22/2028	636	684,650	0.1
HSBC Holdings PLC	4.25%	03/14/2024	USD 1,665	1,281,134	0.2
HSBC Holdings PLC(b)	6.38%	03/30/2025	555	433,120	0.1
ING Groep NV	3.00%	02/18/2026	GBP 1,800	1,946,508	0.2
ING Groep NV(b)	6.88%	04/16/2022	USD 2,235	1,640,646	0.2
Intesa Sanpaolo SpA	3.13%	07/14/2022	2,380	1,724,756	0.2
JPMorgan Chase & Co.	0.99%	04/28/2026	GBP 4,025	4,031,985	0.5
Lloyds Bank PLC	7.50%	04/15/2024	1,520	1,811,617	0.2
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	0.98%	06/09/2024	EUR 599	531,623	0.1
Morgan Stanley	1.34%	10/23/2026	3,613	3,255,957	0.4
Natwest Group PLC	2.11%	11/28/2031	GBP 1,995	1,994,519	0.3
Nordea Bank Abp(a)	1.08%	08/30/2023	USD 1,825	1,302,142	0.2
Nordea Bank Abp(b)	6.13%	09/23/2024	430	333,044	0.0
Societe Generale SA	1.88%	10/03/2024	GBP 2,500	2,561,670	0.3
Standard Chartered PLC(a) (b)	1.70%	01/30/2027	USD 3,200	2,165,779	0.3
Standard Chartered PLC	5.70%	01/25/2022	777	565,357	0.1
Swedbank AB(b)	6.00%	03/17/2022	600	436,053	0.1
Swedbank AB, Series NC5(b)	5.63%	09/17/2024	2,600	1,983,102	0.2
UBS Group AG(b)	5.75%	02/19/2022	EUR 2,115	1,881,179	0.2
UniCredit SpA	2.57%	09/22/2026	USD 4,340	3,106,146	0.4
Virgin Money UK PLC, Series G	0.38%	05/27/2024	EUR 771	665,698	0.1
Wells Fargo & Co.	2.13%	12/20/2023	GBP 3,744	3,865,658	0.5
				<u>83,270,472</u>	<u>10.4</u>
FINANZEN					
Air Lease Corp.	2.88%	01/15/2026	USD 915	675,296	0.1
Air Lease Corp.	3.63%	04/01/2027	139	104,952	0.0
Air Lease Corp.	4.63%	10/01/2028	271	213,467	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	1,117	774,043	0.1
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	369	276,858	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	101	77,080	0.0
Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023	925	698,612	0.1
Aircastle Ltd.	5.00%	04/01/2023	76	57,359	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	928	728,550	0.1
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	126	88,361	0.0
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022	1,008	718,147	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	212	156,409	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023	799	590,048	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	12	9,094	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	432	336,226	0.1
GE Capital European Funding Unlimited Co.	4.63%	02/22/2027	EUR 550	584,552	0.1
JAB Holdings BV	1.25%	05/22/2024	2,700	2,403,676	0.3
				<u>8,492,730</u>	<u>1.1</u>
VERSICHERUNGEN					
Alleghany Corp.	3.63%	05/15/2030	USD 2,245	1,727,910	0.2
American International Group, Inc.	5.00%	04/26/2023	GBP 2,600	2,810,357	0.3
Aon PLC	2.88%	05/14/2026	EUR 2,913	2,819,278	0.3
Assicurazioni Generali SpA	5.00%	06/08/2048	2,186	2,245,052	0.3
Centene Corp.	4.25%	12/15/2027	USD 685	507,009	0.1
Chubb INA Holdings, Inc.	0.30%	12/15/2024	EUR 601	520,943	0.1
Chubb INA Holdings, Inc.	0.88%	06/15/2027	2,545	2,261,188	0.3
Friends Life Holdings PLC	8.25%	04/21/2022	GBP 1,550	1,655,714	0.2
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR 1,405	1,242,133	0.2
Muenchener Rueckversicherungs-Gesellschaft AG in Muenchen	6.63%	05/26/2042	GBP 900	951,258	0.1
				<u>16,740,842</u>	<u>2.1</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	USD 337	260,461	0.0
Digital Dutch Finco BV	1.50%	03/15/2030	EUR 567	508,954	0.1
				<u>769,415</u>	<u>0.1</u>
REITS					
CyrusOne LP/CyrusOne Finance Corp.	1.45%	01/22/2027	557	486,677	0.1
Digital Dutch Finco BV	1.00%	01/15/2032	468	393,232	0.0
Digital Euro Finco LLC	2.50%	01/16/2026	2,358	2,225,208	0.3
EPR Properties	5.25%	07/15/2023	USD 435	320,849	0.0
Vornado Realty LP	2.15%	06/01/2026	2,810	2,000,380	0.2
Westfield America Management L.	2.63%	03/30/2029	GBP 2,025	2,038,912	0.3
WPC Eurobond BV	0.95%	06/01/2030	EUR 741	622,585	0.1
WPC Eurobond BV	2.13%	04/15/2027	1,978	1,834,625	0.2
				<u>9,922,468</u>	<u>1.2</u>
				<u>119,195,927</u>	<u>14.9</u>

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE							
ELEKTRIZITÄT							
	Consolidated Edison Co. of New York, Inc., Series C(a)	0.60%	06/25/2021	USD	1,485	£ 1,046,706	0.1%
	E.ON International Finance BV	5.63%	12/06/2023	GBP	3,500	3,926,300	0.5
	EDP Finance BV, Series E	8.63%	01/04/2024		875	1,048,255	0.1
	Electricite de France SA(b)	2.88%	12/15/2026	EUR	1,400	1,230,685	0.2
	Enel Finance International NV	2.65%	09/10/2024	USD	2,490	1,846,091	0.2
	Enel Finance International NV	3.63%	05/25/2027		1,940	1,503,392	0.2
	Iberdrola Finanzas SA	7.38%	01/29/2024	GBP	3,000	3,523,554	0.4
	Iberdrola International BV, Series NC6(b)	1.45%	11/09/2026	EUR	600	516,944	0.1
	Vattenfall AB	3.00%	03/19/2077		1,345	1,241,120	0.2
	Western Power Distribution East Midlands PLC	5.25%	01/17/2023	GBP	3,500	3,760,925	0.5
						<u>19,643,972</u>	<u>2.5</u>
ERDGAS							
	Centrica PLC	4.38%	03/13/2029		1,440	1,705,605	0.2
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE							
	Thames Water Utilities Finance PLC	1.88%	01/24/2024		377	387,891	0.0
	Veolia Environnement SA	0.89%	01/14/2024	EUR	4,100	3,607,692	0.5
	Veolia Environnement SA(b)	2.25%	01/20/2026		1,900	1,653,177	0.2
	Yorkshire Water Finance PLC	6.59%	02/21/2023	GBP	2,838	3,123,814	0.4
						<u>8,772,574</u>	<u>1.1</u>
						<u>30,122,151</u>	<u>3.8</u>
						<u>292,272,039</u>	<u>36.6</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE							
AUSTRALIEN							
	Australia Government Bond, Series 142	4.25%	04/21/2026	AUD	83,712	53,257,125	6.6
	Australia Government Bond, Series 144	3.75%	04/21/2037		21,690	14,364,904	1.8
	Australia Government Bond, Series 145	2.75%	06/21/2035		22,505	13,363,280	1.7
	Australia Government Bond, Series 160	1.00%	12/21/2030		50,840	26,202,416	3.3
						<u>107,187,725</u>	<u>13.4</u>
CHINA							
	China Government Bond, Series INBK	3.27%	11/19/2030	CNY	43,540	4,889,406	0.6
KOLUMBIEN							
	Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP	12,833,000	2,342,600	0.3
ITALIEN							
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.95%	09/15/2027	EUR	26,887	23,897,091	3.0
MEXIKO							
	Mexican Bonos, Series M	7.75%	05/29/2031	MXN	281,830	10,740,005	1.3
VEREINIGTE STAATEN							
	U.S. Treasury Notes	0.75%	01/31/2028	USD	23,170	15,857,283	2.0
						<u>164,914,110</u>	<u>20.6</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT							
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
	Axalta Coating Systems LLC	3.38%	02/15/2029		821	558,376	0.1
	INEOS Quattro Finance 2 PLC	2.50%	01/15/2026	EUR	950	819,599	0.1
	INEOS Quattro Finance 2 PLC	3.38%	01/15/2026	USD	233	164,271	0.0
	Ingevity Corp.	3.88%	11/01/2028		1,039	723,715	0.1
	Sealed Air Corp.	4.50%	09/15/2023	EUR	852	791,486	0.1
	Solvay SA(b)	2.50%	12/02/2025		900	793,273	0.1
	SPCM SA	2.00%	02/01/2026		1,830	1,601,305	0.2
	Synthomer PLC	3.88%	07/01/2025		1,330	1,195,175	0.1
	WEPA Hygieneprodukte GmbH	2.88%	12/15/2027		1,765	1,501,630	0.2
						<u>8,148,830</u>	<u>1.0</u>
INVESTITIONSGÜTER							
	Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC	2.00%	09/01/2028		1,950	1,670,707	0.2
	Colfax Corp.	3.25%	05/15/2025		1,841	1,595,944	0.2
	GFL Environmental, Inc.	3.75%	08/01/2025	USD	1,640	1,182,688	0.2
	Silgan Holdings, Inc.	2.25%	06/01/2028	EUR	772	666,192	0.1
	TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027		1,885	1,695,272	0.2
						<u>6,810,803</u>	<u>0.9</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN							
	Cable One, Inc.	4.00%	11/15/2030	USD	718	501,386	0.1
	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030		310	222,551	0.0
	CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033		1,111	781,767	0.1
	Netflix, Inc.	3.63%	05/15/2027	EUR	1,042	1,027,533	0.2
	Netflix, Inc.	4.63%	05/15/2029		916	980,926	0.1
	Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	08/01/2022	USD	1,335	944,839	0.1
						<u>4,459,002</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover- mögen %
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Lumen Technologies, Inc.	4.50%	01/15/2029	USD 1,443	£ 983,600	0.1%
T-Mobile USA, Inc.	2.63%	04/15/2026	2,183	1,565,930	0.2
Telecom Italia SpA/Milano	1.63%	01/18/2029	EUR 1,875	1,575,545	0.2
Telefonica Europe BV(b)	4.38%	12/14/2024	1,300	1,207,434	0.2
				<u>5,332,509</u>	<u>0.7</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Allison Transmission, Inc.	3.75%	01/30/2031	USD 1,380	934,279	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	EUR 925	823,780	0.1
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023	USD 2,047	1,610,564	0.2
Schaeffler AG	2.75%	10/12/2025	EUR 1,900	1,731,852	0.2
				<u>5,100,475</u>	<u>0.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	1.88%	11/07/2022	2,735	2,324,200	0.3
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	3.50%	02/15/2029	USD 1,604	1,105,715	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Levi Strauss & Co.	3.50%	03/01/2031	767	532,357	0.0
Marks & Spencer PLC	4.50%	07/10/2027	GBP 640	682,824	0.1
				<u>1,215,181</u>	<u>0.1</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Avantor Funding, Inc.	2.63%	11/01/2025	EUR 1,764	1,555,640	0.2
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	465	402,141	0.1
Grifols SA	1.63%	02/15/2025	2,365	2,046,096	0.3
IQVIA, Inc.	1.75%	03/15/2026	2,415	2,093,042	0.3
IQVIA, Inc.	2.88%	06/15/2028	1,306	1,157,415	0.1
Newell Brands, Inc.	4.70%	04/01/2026	USD 1,108	877,473	0.1
Newell Brands, Inc.	4.88%	06/01/2025	273	213,913	0.0
Organon Finance I LLC	4.13%	04/30/2028	2,496	1,774,925	0.2
Tenet Healthcare Corp.	4.63%	07/15/2024	1,373	980,261	0.1
				<u>11,100,906</u>	<u>1.4</u>
ENERGIE					
Occidental Petroleum Corp.(a)	1.61%	08/15/2022	2,143	1,499,218	0.2
Occidental Petroleum Corp.	3.50%	08/15/2029	1,885	1,245,527	0.1
Targa Resources Partners LP/Targa Resources Partners Finance Corp.	6.50%	07/15/2027	1,820	1,390,044	0.2
Western Midstream Operating LP	4.35%	02/01/2025	2,425	1,788,318	0.2
				<u>5,923,107</u>	<u>0.7</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	EUR 442	390,430	0.1
H&E Equipment Services, Inc.	3.88%	12/15/2028	USD 1,088	742,193	0.1
Rexel SA	2.13%	06/15/2028	EUR 525	458,435	0.0
				<u>1,591,058</u>	<u>0.2</u>
Dienstleistungen					
Elis SA	1.75%	04/11/2024	2,400	2,104,784	0.3
Intertrust Group BV	3.38%	11/15/2025	2,085	1,831,198	0.2
Square, Inc.	2.75%	06/01/2026	USD 2,205	1,566,179	0.2
				<u>5,502,161</u>	<u>0.7</u>
TECHNOLOGIE					
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024	1,053	764,499	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	7.13%	06/15/2024	1,330	957,404	0.1
Microchip Technology, Inc.	4.25%	09/01/2025	1,585	1,172,193	0.2
				<u>2,894,096</u>	<u>0.4</u>
				<u>61,508,043</u>	<u>7.7</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(b)	6.50%	03/05/2025	2,000	1,530,210	0.2
Banco Santander SA(b)	6.75%	04/25/2022	EUR 2,200	1,978,255	0.2
Credit Suisse Group AG(b)	7.50%	12/11/2023	USD 2,597	2,024,403	0.3
Societe Generale SA(b)	7.38%	09/13/2021	1,560	1,117,255	0.1
				<u>6,650,123</u>	<u>0.8</u>
FINANZEN					
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR 2,131	1,854,207	0.3
SLM Corp.	4.20%	10/29/2025	USD 1,292	964,885	0.1
				<u>2,819,092</u>	<u>0.4</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Intrum AB	3.50%	07/15/2026	EUR 1,730	1,505,441	0.2
REITS					
ADLER Group SA	2.75%	11/13/2026	300	261,667	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover- mögen %
ADLER Group SA	3.25%	08/05/2025	EUR 1,200	£ 1,071,406	0.1%
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/MGP Finance Co-Issuer, Inc.	4.63%	06/15/2025	USD 784	586,629	0.1
				1,919,702	0.2
				12,894,358	1.6
				74,402,401	9.3
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABLE VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2019-3A, Class M1B(a)	1.69%	07/25/2029	726	512,919	0.1
Series 2019-4A, Class M1C(a)	2.59%	10/25/2029	1,394	982,076	0.1
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1M2(a)	2.49%	04/25/2031	435	308,272	0.0
Series 2019-R03, Class 1M2(a)	2.24%	09/25/2031	721	510,971	0.1
Series 2019-R05, Class 1M2(a)	2.09%	07/25/2039	388	274,842	0.0
Series 2019-R06, Class 2M2(a)	2.19%	09/25/2039	487	343,564	0.0
Series 2019-R07, Class 1M2(a)	2.19%	10/25/2039	978	692,464	0.1
Eagle RE Ltd., Series 2018-1, Class M1(a)	1.79%	11/25/2028	447	316,208	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2013-DN2, Class M2(a)	4.34%	11/25/2023	1,402	1,010,531	0.1
Series 2014-DN3, Class M3(a)	4.09%	08/25/2024	646	465,009	0.1
Series 2014-HQ1, Class M3(a)	4.19%	08/25/2024	296	211,329	0.0
Series 2016-DNA1, Class M3(a)	5.64%	07/25/2028	582	429,729	0.1
Series 2016-DNA2, Class M3(a)	4.74%	10/25/2028	1,411	1,039,460	0.1
Series 2016-DNA3, Class M3(a)	5.09%	12/25/2028	1,702	1,262,034	0.2
Series 2016-DNA4, Class M3(a)	3.89%	03/25/2029	653	478,213	0.1
Series 2016-HQA1, Class M3(a)	6.44%	09/25/2028	2,655	1,996,640	0.3
Series 2016-HQA3, Class M3(a)	3.94%	03/25/2029	1,200	879,376	0.1
Series 2016-HQA4, Class M3(a)	3.99%	04/25/2029	1,696	1,240,728	0.2
Series 2017-DNA1, Class M2(a)	3.34%	07/25/2029	1,584	1,152,969	0.1
Series 2017-DNA2, Class M1(a)	1.29%	10/25/2029	204	144,274	0.0
Series 2017-DNA2, Class M2(a)	3.54%	10/25/2029	1,880	1,380,952	0.2
Series 2017-DNA2, Class M2B(a)	3.54%	10/25/2029	309	224,442	0.0
Series 2017-DNA3, Class M2(a)	2.59%	03/25/2030	3,328	2,395,956	0.3
Series 2017-HQA1, Class M2(a)	3.64%	08/25/2029	3,607	2,626,444	0.3
Series 2017-HQA2, Class M2(a)	2.74%	12/25/2029	868	623,902	0.1
Series 2017-HQA3, Class M2(a)	2.44%	04/25/2030	2,680	1,931,034	0.2
Series 2018-HQA1, Class M2(a)	2.39%	09/25/2030	1,205	855,064	0.1
Series 2019-DNA3, Class M2(a)	2.14%	07/25/2049	168	119,607	0.0
Series 2020-DNA1, Class M2(a)	1.79%	01/25/2050	1,553	1,098,226	0.1
Series 2020-HQA2, Class M2(a)	3.19%	03/25/2050	548	392,436	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C03, Class 2M2(a)	2.99%	07/25/2024	478	342,934	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	4.99%	11/25/2024	1,668	1,214,112	0.2
Series 2014-C04, Class 2M2(a)	5.09%	11/25/2024	505	365,455	0.1
Series 2015-C02, Class 1M2(a)	4.09%	05/25/2025	966	696,193	0.1
Series 2015-C02, Class 2M2(a)	4.09%	05/25/2025	188	134,443	0.0
Series 2015-C03, Class 2M2(a)	5.09%	07/25/2025	271	193,844	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(a)	5.79%	04/25/2028	41	30,830	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(a)	5.64%	04/25/2028	787	585,043	0.1
Series 2016-C01, Class 1M2(a)	6.84%	08/25/2028	1,541	1,162,813	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(a)	7.04%	08/25/2028	812	608,060	0.1
Series 2016-C02, Class 1M2(a)	6.09%	09/25/2028	1,354	1,005,596	0.1
Series 2016-C03, Class 2M2(a)	5.99%	10/25/2028	1,021	759,623	0.1
Series 2016-C04, Class 1M2(a)	4.34%	01/25/2029	343	251,825	0.0
Series 2016-C05, Class 2M2(a)	4.54%	01/25/2029	969	711,846	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(a)	4.34%	04/25/2029	1,836	1,349,109	0.2
Series 2016-C06, Class 1M2B(a)	4.34%	04/25/2029	1,030	753,983	0.1
Series 2016-C07, Class 2M2(a)	4.44%	05/25/2029	1,149	847,246	0.1
Series 2017-C01, Class 1M2(a)	3.64%	07/25/2029	1,100	804,024	0.1
Series 2017-C02, Class 2M2(a)	3.74%	09/25/2029	1,563	1,142,962	0.1
Series 2017-C04, Class 2M2(a)	2.94%	11/25/2029	934	674,927	0.1
Series 2017-C05, Class 1M2(a)	2.29%	01/25/2030	843	602,390	0.1
Series 2017-C06, Class 1M2(a)	2.74%	02/25/2030	1,465	1,051,427	0.1
Series 2017-C06, Class 2M2(a)	2.89%	02/25/2030	1,531	1,102,232	0.1
Series 2018-C01, Class 1B1(a)	3.64%	07/25/2030	248	179,166	0.0
Series 2018-C01, Class 1M2(a)	2.34%	07/25/2030	1,313	933,288	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-3R, Class A(a)	2.79%	10/27/2022	148	104,860	0.0
Radnor Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(a)	2.04%	02/25/2029	530	374,723	0.1
Series 2019-1, Class M2(a)	3.29%	02/25/2029	1,647	1,177,243	0.2
STACR Trust, Series 2018-DNA3, Class M2(a)	2.19%	09/25/2048	1,939	1,382,193	0.2
				46,442,061	5.8

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (GBP)	Nettover- mögen %
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Bear Stearns ARM Trust					
Series 2007-3, Class 1A1	3.16%	05/25/2047	USD 92	£ 64,722	0.0%
Series 2007-4, Class 22A1	3.43%	06/25/2047	488	343,666	0.1
Residential Asset Securitization Trust, Series 2006-A8, Class 3A4 ..	6.00%	08/25/2036	114	59,176	0.0
				<u>467,564</u>	<u>0.1</u>
NICHT STAATLICH VARIABLE VERZINSLICH					
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2005-8, Class 2A2(a) (d) ...	4.71%	09/25/2035	44	650	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,					
Series 2007-FA2, Class 1A6(a) (d)	5.46%	04/25/2037	69	8,656	0.0
Impac Secured Assets Corp., Series 2005-2, Class A2D(a)	0.95%	03/25/2036	161	101,840	0.0
Lehman XS Trust, Series 2007-10H, Class 2AIO(a) (d)	6.89%	07/25/2037	146	19,072	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust, Series 2006-QS18,					
Class 2A2(a) (d)	6.46%	12/25/2036	1,886	233,991	0.0
				<u>364,209</u>	<u>0.0</u>
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal National Mortgage Association REMICs, Series 3067,					
Class FA(a)	0.45%	11/15/2035	190	134,358	0.0
				<u>47,408,192</u>	<u>5.9</u>
INFLATIONSGEBUNDENE WERTPAPIERE					
FRANKREICH					
French Republic Government Bond OAT, Series OATE	0.10%	03/01/2026	EUR 11,494	10,802,101	1.3
DEUTSCHLAND					
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	0.10%	04/15/2026	35,214	33,263,429	4.2
				<u>44,065,530</u>	<u>5.5</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
KANADA					
Canada Housing Trust No. 1	1.80%	12/15/2024	CAD 20,760	12,527,162	1.6
Canada Housing Trust No. 1	1.95%	12/15/2025	33,470	20,306,006	2.5
				<u>32,833,168</u>	<u>4.1</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - China Bond Portfolio - Class SA			1,903,436	21,595,495	2.7
GEDECKTE ANLEIHEN					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.(a)	0.73%	01/24/2022	GBP 2,210	2,218,897	0.3
Bank of Nova Scotia (The)(a)	0.35%	01/10/2023	4,190	4,199,577	0.5
Canadian Imperial Bank of Commerce(a)	0.52%	01/10/2022	4,155	4,163,466	0.5
Korea Housing Finance Corp.	2.00%	10/11/2021	USD 2,555	1,810,275	0.2
Royal Bank of Canada(a)	0.31%	12/08/2022	GBP 2,986	2,989,324	0.4
Toronto-Dominion Bank (The), Series G(a)	0.30%	01/30/2023	4,440	4,444,293	0.6
				<u>19,825,832</u>	<u>2.5</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	3.88%	03/22/2026	EUR 2,150	2,058,528	0.3
FRANKREICH					
Dexia Credit Local SA	1.13%	06/15/2022	GBP 7,800	7,874,636	1.0
INDONESIEN					
Indonesia Government International Bond	3.38%	07/30/2025	EUR 3,090	2,966,003	0.4
PANAMA					
Panama Government International Bond	8.88%	09/30/2027	USD 1,850	1,807,356	0.2
PHILIPPINEN					
Philippine Government International Bond	0.00%	02/03/2023	EUR 1,773	1,522,841	0.2
KATAR					
Qatar Government International Bond	3.40%	04/16/2025	USD 440	338,395	0.0
SÜDKOREA					
LG Display Co., Ltd.	3.88%	11/15/2021	1,096	782,647	0.1
				<u>17,350,406</u>	<u>2.2</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
CHINA					
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd.	2.15%	05/13/2025	2,819	2,039,100	0.3
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	1.25%	05/19/2022	EUR 2,155	1,872,932	0.2
				<u>3,912,032</u>	<u>0.5</u>
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	USD 722	555,306	0.1

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover- mögen %
MEXIKO							
	Comision Federal de Electricidad	3.35%	02/09/2031	USD	2,871	£ 1,992,696	0.2%
	Petroleos Mexicanos	6.50%	03/13/2027		2,745	2,065,225	0.3
						4,057,921	0.5
SÜDKOREA							
	Korea Development Bank (The)(a)	0.68%	10/01/2022		4,820	3,405,622	0.4
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE							
	DP World Crescent Ltd.	4.85%	09/26/2028		2,240	1,787,056	0.2
	MDGH - GMTN BV	2.50%	11/07/2024		2,373	1,753,644	0.2
						3,540,700	0.4
						15,471,581	1.9
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN							
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS							
	Commercial Mortgage Trust, Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047		2,000	1,544,641	0.2
	DBUBS Mortgage Trust, Series 2011-LC2A, Class D	5.39%	07/10/2044		1,149	809,290	0.1
	GS Mortgage Securities Trust						
	Series 2010-C1, Class A2	4.59%	08/10/2043		13	9,030	0.0
	Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044		80	34,209	0.0
	Series 2013-G1, Class A1	2.06%	04/10/2031		178	126,136	0.0
	JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust, Series						
	2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047		868	660,159	0.1
	JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust,						
	Series 2012-C8, Class B	3.98%	10/15/2045		1,050	742,169	0.1
	LSTAR Commercial Mortgage Trust, Series 2016-4, Class A2	2.58%	03/10/2049		1,001	715,929	0.1
	Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust,						
	Series 2013-C9, Class D	4.11%	05/15/2046		280	178,528	0.0
						4,820,091	0.6
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS							
	BHMS, Series 2018-ATLS, Class A(a)	1.35%	07/15/2035		2,018	1,422,055	0.2
	BX Trust, Series 2018-EXCL, Class A(a)	1.19%	09/15/2037		2,405	1,654,039	0.2
						3,076,094	0.4
						7,896,185	1.0
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN							
KANADA							
	Province of Alberta Canada	1.00%	11/15/2021	GBP	3,635	3,647,663	0.5
	Province of Quebec Canada	4.20%	03/10/2025	AUD	6,487	3,949,138	0.5
						7,596,801	1.0
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE							
KENIA							
	Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024	USD	2,420	1,893,143	0.3
ÄGYPTEN							
	Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031		2,320	1,605,662	0.2
BAHRAIN							
	Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031		1,790	1,266,285	0.2
	Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030		206	162,648	0.0
						1,428,933	0.2
SENEGAL							
	Senegal Government International Bond	6.25%	07/30/2024		1,000	783,612	0.1
NIGERIA							
	Nigeria Government International Bond	5.63%	06/27/2022		970	709,054	0.1
OMAN							
	Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025		397	292,386	0.0
DOMINIKANISCHE REPUBLIK							
	Dominican Republic International Bond	5.30%	01/21/2041		230	162,403	0.0
						6,875,193	0.9
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN							
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
	Braskem Finance Ltd.	6.45%	02/03/2024		1,750	1,391,744	0.2
	Klabin Austria GmbH	3.20%	01/12/2031		453	307,992	0.0
	Volcan Cia Minera SAA.	4.38%	02/11/2026		347	238,675	0.0
						1,938,411	0.2
INVESTITIONSGÜTER							
	Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031		1,559	1,099,231	0.1
	Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027		740	553,703	0.1
	Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028		788	631,842	0.1
	Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058		1,125	7,924	0.0
						2,292,700	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (GBP)	Nettover- mögen %
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	USD 936	£ 671,216	0.1%
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	631	488,927	0.1
DIENSTLEISTUNGEN					
MercadoLibre, Inc.	3.13%	01/14/2031	200	136,723	0.0
				5,527,977	0.7
FINANZINSTITUTE					
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(e)	7.13%	12/26/2046	920	76,178	0.0
				5,604,155	0.7
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABLE VERZINSLICH					
Golub Capital Partners 48 LP Series 2020-48A, Class A1(a)	1.50%	04/17/2033	1,720	1,211,380	0.2
ABS-ANLEIHEN					
BAUSPARDARLEHEN – FESTVERZINSLICH					
GSAA Home Equity Trust, Series 2006-6, Class AF4.	6.62%	03/25/2036	454	135,028	0.0
				759,457,496	95.1
GELDMARKTINSTRUMENTE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTES KÖNIGREICH					
United Kingdom Treasury Bill.	0.00%	10/18/2021	GBP 12,025	12,021,269	1.5
				771,478,765	96.6
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABLE VERZINSLICH					
Apidos CLO XXXIII Series 2020-33A, Class A(a).	1.88%	07/24/2031	USD 2,329	1,642,610	0.2
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2015-XLF2, Class SNMD(a)	1.84%	11/15/2026	1,100	114,911	0.0
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
Virgolino de Oliveira Finance SA(f)	10.50%	01/28/2018	1,371	9,163	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(g)	11.75%	02/09/2022	499	1,754	0.0
				10,917	0.0
				1,768,438	0.2
Gesamtanlagen				£ 773,247,203	96.8%
(Kosten £795,216,529).					
Termineinlagen					
ANZ, London(h)	(0.13)%	—		626,882	0.1
Bank of Nova Scotia, Toronto(h)	0.01 %	—		4,087,774	0.5
Bank of Nova Scotia, Toronto(h)	0.01 %	—		657,583	0.1
Nordea Bank Abp, Oslo(h)	(0.78)%	—		838,241	0.1
Sumitomo, London(h)	(0.29)%	—		631,336	0.1
Sumitomo, Tokyo(h)	0.01 %	—		1,600,256	0.1
Termineinlagen insgesamt				8,442,072	1.0
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				17,215,919	2.2
Nettovermögen				£ 798,905,194	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Short					
Canadian 10 Yr Bond Futures	09/21/2021	187	£ 15,734,003	£ 15,734,184	£ (181)
Euro-BOBL Futures	06/08/2021	934	108,342,528	108,138,191	204,337
Euro-Bund Futures	06/08/2021	162	23,785,921	23,656,272	129,649
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2021	214	21,808,653	21,858,133	(49,480)
					£ 284,325
				Wertsteigerung	£ 333,986
				Wertminderung	£ (49,661)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	AUD 2,282	GBP 1,273	06/04/2021	£ 33,535
Bank of America, NA	USD 84,787	GBP 61,189	06/18/2021	1,444,647
Bank of America, NA	CNH 86,014	GBP 9,412	06/24/2021	(104,041)
Bank of America, NA	HUF 6,807,190	GBP 15,965	06/24/2021	(826,333)
Bank of America, NA	USD 11,339	RUB 842,424	07/28/2021	48,143
Barclays Bank PLC	IDR 79,816,661	USD 5,396	07/15/2021	(113,097)
Barclays Bank PLC	EUR 13,271	GBP 11,547	07/16/2021	134,105
BNP Paribas SA	USD 11,250	AUD 14,348	06/04/2021	(133,477)
BNP Paribas SA	USD 2,178	GBP 1,539	06/17/2021	4,116
BNP Paribas SA	MXN 61,193	GBP 2,166	06/18/2021	5,487
BNP Paribas SA	GBP 16,216	HUF 6,743,249	06/24/2021	418,211
BNP Paribas SA	PLN 64,868	USD 17,083	06/24/2021	(396,787)
BNP Paribas SA	USD 52,958	GBP 38,386	06/24/2021	1,070,229
BNP Paribas SA	EUR 12,055	GBP 10,421	08/31/2021	45,224
BNP Paribas SA	EUR 55,517	GBP 48,218	09/17/2021	416,602
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD 18,509	GBP 10,304	06/04/2021	249,076
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 1,058	AUD 1,896	06/04/2021	(28,195)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 3,200	USD 4,535	06/17/2021	(4,851)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN 86,132	GBP 3,083	06/18/2021	42,071
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN 96,904	GBP 3,415	06/18/2021	(6,866)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 60,965	GBP 52,497	07/30/2021	53,833
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 1,627	EUR 1,878	08/03/2021	(10,678)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 190	CHF 243	06/21/2021	155
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 20,101	EUR 23,293	06/21/2021	(79,021)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 11,067	SGD 20,887	06/21/2021	61,169
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 16	USD 23	06/21/2021	(40)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 216	CHF 274	06/30/2021	(1,316)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 21,875	EUR 25,312	06/30/2021	(114,580)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 11,122	SGD 20,836	06/30/2021	(21,298)
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP 17	USD 25	06/30/2021	(55)
Citibank, NA	AUD 192,352	GBP 106,460	06/04/2021	1,971,016
Citibank, NA	COP 15,094,167	USD 4,018	07/15/2021	(29,835)
Citibank, NA	IDR 79,576,833	USD 5,592	07/15/2021	36,811
Citibank, NA	INR 837,426	USD 11,318	07/15/2021	(113,331)
Citibank, NA	USD 5,283	CLP 3,774,436	07/15/2021	(53,239)
Citibank, NA	KRW 12,639,882	USD 11,299	07/22/2021	(33,534)
Credit Suisse International	CHF 10,192	USD 11,326	08/05/2021	(16,676)
Deutsche Bank AG	EUR 64,796	GBP 55,509	06/16/2021	(183,629)
Deutsche Bank AG	USD 44,684	GBP 32,248	06/17/2021	762,430
Deutsche Bank AG	INR 87,971	USD 1,182	07/15/2021	(16,746)
Goldman Sachs Bank USA	BRL 4,852	USD 913	06/02/2021	(12,386)
Goldman Sachs Bank USA	USD 903	BRL 4,852	06/02/2021	19,728
Goldman Sachs Bank USA	USD 7,513	GBP 5,437	06/17/2021	142,810
Goldman Sachs Bank USA	MXN 64,350	USD 3,171	06/18/2021	(37,769)
Goldman Sachs Bank USA	USD 11,311	PLN 42,323	06/24/2021	142,315
Goldman Sachs Bank USA	USD 911	BRL 4,852	07/02/2021	12,266
HSBC Bank USA	USD 1,695	GBP 1,199	06/17/2021	4,136
HSBC Bank USA	ZAR 169,712	GBP 8,370	06/17/2021	(289,806)
JPMorgan Chase Bank, NA	AUD 14,109	USD 10,957	06/04/2021	56,659
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 43,137	GBP 30,807	06/17/2021	410,944
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 11,966	ZAR 168,746	06/17/2021	179,500
JPMorgan Chase Bank, NA	PLN 22,188	USD 5,673	06/24/2021	(255,741)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 11,824	PLN 44,728	06/24/2021	242,199
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR 14,021,031	USD 949	07/15/2021	(19,234)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 75,484	GBP 53,120	07/15/2021	(67,223)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 11,340	NOK 94,371	07/15/2021	(38,621)
Morgan Stanley & Co. LLC	GBP 7,061	USD 9,992	06/17/2021	(20,442)
Morgan Stanley & Co. LLC	USD 46,701	GBP 33,858	06/17/2021	950,811
Morgan Stanley & Co. LLC	USD 5,518	CLP 4,052,825	07/15/2021	51,967
Morgan Stanley & Co. LLC	USD 11,004	INR 835,342	07/15/2021	314,597
Morgan Stanley & Co. LLC	CLP 11,682,732	USD 16,439	07/15/2021	225,718
Morgan Stanley & Co. LLC	CHF 5,115	GBP 4,051	08/05/2021	37,510
Morgan Stanley & Co. LLC	JPY 1,359,963	GBP 8,795	08/19/2021	65,173
Royal Bank of Scotland PLC	CAD 59,153	GBP 33,843	07/16/2021	(657,167)
Standard Chartered Bank	EUR 60,967	GBP 53,072	06/29/2021	658,377
Standard Chartered Bank	KRW 785,516	USD 705	07/22/2021	(446)
Standard Chartered Bank	USD 11,209	KRW 12,634,323	07/22/2021	93,605
Standard Chartered Bank	GBP 1,768	EUR 2,052	08/03/2021	(2,993)
UBS AG	USD 5,371	CLP 3,852,507	07/15/2021	(39,375)
UBS AG	EUR 8,804	GBP 7,602	08/16/2021	25,756
				£ 6,702,103
			Wertsteigerung	£ 10,430,931
			Wertminderung	£ (3,728,828)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen 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	£ (55,161)	£ (34,906)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	BRL 34,667	01/02/2023	1 Day CDI	4.053%	£ (110,456)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	37,875	01/02/2023	1 Day CDI	4.590%	(68,387)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	68,324	01/02/2023	1 Day CDI	4.910%	(137,977)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	51,857	01/02/2023	1 Day CDI	4.975%	(96,698)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	35,624	01/02/2023	1 Day CDI	4.915%	(72,570)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	20,837	01/02/2023	1 Day CDI	4.940%	(41,211)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	18,639	01/02/2023	1 Day CDI	4.945%	(37,200)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	37,887	01/02/2023	1 Day CDI	3.975%	(129,058)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	34,871	01/02/2023	1 Day CDI	4.175%	(99,400)
Insgesamt					£ (792,957)

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	£ (61,302)	£ (35,108)	£ (26,194)
JPMorgan Chase Bank, NA	Campbell Soup Co.	12/20/2023	USD 4,020	(55,966)	27,020	(82,986)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,700	(535,187)	(228,099)	(307,088)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,742	(543,512)	(265,624)	(277,888)
Insgesamt				£ (1,195,967)	£ (501,811)	£ (694,156)
Swaps insgesamt						£ (1,522,019)

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2021.
- (b) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (c) Wertpapier per Emission (When Issued) oder auf Termin (Delayed Delivery).
- (d) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (e) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (f) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (g) Not leidend.
- (h) 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
 HUF – Hungarian Forint
 IDR – Indonesian Rupiah
 INR – Indian Rupee
 JPY – Japanese Yen
 KRW – South Korean Won

MXN – Mexican Peso
NOK – Norwegian Krone
PLN – Polish Zloty
RUB – Russian Ruble
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

BOBL – Bundesobligationen
CDI – Brazil CETIP Interbank Deposit Rate
CDX-CMBX.NA – North American Commercial Mortgage-Backed Index
CLO – Collateralized Loan Obligations
CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities
CME – Chicago Mercantile Exchange
GMTN – Global Medium Term Note
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
OAT – Obligations Assimilables du Trésor
REMICs – Real Estate Mortgage Investment Conduits

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN					
Amphenol Corp. - Class A			939,655	\$ 63,201,195	4.9%
CDW Corp./DE			379,642	62,800,380	4.8
				<u>126,001,575</u>	<u>9.7</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
Automatic Data Processing, Inc.			253,657	49,721,845	3.8
Mastercard, Inc. - Class A			295,744	106,639,372	8.2
				<u>156,361,217</u>	<u>12.0</u>
SOFTWARE					
Adobe, Inc.			57,696	29,112,247	2.2
Microsoft Corp.			482,854	120,558,987	9.3
				<u>149,671,234</u>	<u>11.5</u>
				<u>432,034,026</u>	<u>33.2</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
Aptiv PLC			424,196	63,807,563	4.9
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB					
Amazon.com, Inc.			19,472	62,759,619	4.8
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL					
TJX Cos., Inc. (The)			814,187	54,990,190	4.2
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER					
NIKE, Inc. - Class B			641,035	87,475,636	6.7
				<u>269,033,008</u>	<u>20.6</u>
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF					
Abbott Laboratories			779,454	90,923,309	7.0
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN					
IQVIA Holdings, Inc.			390,143	93,696,743	7.2
PHARMAZEUTIKA					
Zoetis, Inc.			359,633	63,539,958	4.8
				<u>248,160,010</u>	<u>19.0</u>
INDUSTRIEGÜTER					
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF					
Stericycle, Inc.			690,911	54,277,968	4.2
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN					
Verisk Analytics, Inc. - Class A			245,488	42,427,691	3.2
				<u>96,705,659</u>	<u>7.4</u>
FINANZWERTE					
KAPITALMÄRKTE					
Charles Schwab Corp. (The)			863,286	63,753,671	4.9
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
American Tower Corp.			247,785	63,299,156	4.9
KOMMUNIKATIONS-DIENSTLEISTUNGEN					
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Facebook, Inc. - Class A			192,428	63,256,857	4.9
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
International Flavors & Fragrances, Inc.			345,620	48,963,985	3.8
Gesamtanlagen					
(Kosten \$910,606,775).				<u>\$ 1,285,206,372</u>	<u>98.7%</u>
Termineinlagen					
JPMorgan Chase, New York(a)	0.01 %	—		12,284,544	0.9
Sumitomo, London(a)	0.01 %	—		2	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>12,284,546</u>	<u>0.9</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>5,183,166</u>	<u>0.4</u>
Nettovermögen				<u>\$ 1,302,674,084</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	4,124	AUD	5,316	06/30/2021	\$ (25,741)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	3,496	CHF	3,133	06/30/2021	(10,526)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	64,046	EUR	52,381	06/30/2021	(135,355)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6,863	GBP	4,851	06/30/2021	22,000
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10,618	SGD	14,066	06/30/2021	17,257
						<u>\$ (132,365)</u>
					Wertsteigerung	\$ 39,257
					Wertminderung	\$ (171,622)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Glossar:

REIT – Real Estate Investment Trust

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 GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Keyence Corp.	28,900	\$ 14,285,725	2.1%
Murata Manufacturing Co., Ltd.	238,200	18,043,027	2.6
		<u>32,328,752</u>	<u>4.7</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Automatic Data Processing, Inc.	109,225	21,410,285	3.1
Capgemini SE	148,204	27,709,677	4.1
Mastercard, Inc. - Class A	73,573	26,528,952	3.9
		<u>75,648,914</u>	<u>11.1</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV	37,437	25,292,076	3.7
SOFTWARE			
Microsoft Corp.	115,543	28,848,776	4.2
SAP SE	98,682	13,816,835	2.0
		<u>42,665,611</u>	<u>6.2</u>
		<u>175,935,353</u>	<u>25.7</u>
INDUSTRIEGÜTER			
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Stericycle, Inc.	166,477	13,078,433	1.9
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Nidec Corp.	176,300	20,215,942	3.0
MASCHINEN			
Alstom SA	375,188	21,171,343	3.1
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Recruit Holdings Co., Ltd.	405,700	20,794,576	3.0
Verisk Analytics, Inc. - Class A	99,415	17,181,894	2.5
		<u>37,976,470</u>	<u>5.5</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Ashtead Group PLC	327,221	23,869,995	3.5
		<u>116,312,183</u>	<u>17.0</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Genmab A/S	52,797	21,566,072	3.1
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	165,631	19,320,856	2.8
Koninklijke Philips NV	237,490	13,419,700	2.0
		<u>32,740,556</u>	<u>4.8</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Eurofins Scientific SE	138,160	14,801,930	2.2
IQVIA Holdings, Inc.	95,307	22,888,929	3.3
		<u>37,690,859</u>	<u>5.5</u>
PHARMAZEUTIKA			
Zoetis, Inc.	114,700	20,265,196	3.0
		<u>112,262,683</u>	<u>16.4</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	171,294	25,766,043	3.8
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	79,298	16,966,600	2.5
Amazon.com, Inc.	3,852	12,415,266	1.8
		<u>29,381,866</u>	<u>4.3</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
TJX Cos., Inc. (The)	300,024	20,263,621	2.9
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
NIKE, Inc. - Class B	99,513	13,579,544	2.0
		<u>88,991,074</u>	<u>13.0</u>
KOMMUNIKATIONS-DIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
Walt Disney Co. (The)	103,869	18,556,197	2.7

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN					
Facebook, Inc. - Class A			55,361	\$ 18,198,822	2.7%
Tencent Holdings Ltd.			258,815	20,234,392	2.9
				<u>38,433,214</u>	<u>5.6</u>
				<u>56,989,411</u>	<u>8.3</u>
FINANZWERTE					
KAPITALMÄRKTE					
Charles Schwab Corp. (The)			454,958	33,598,648	4.9
VERSICHERUNGEN					
AIA Group Ltd.			953,243	12,722,280	1.9
				<u>46,320,928</u>	<u>6.8</u>
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Treasury Wine Estates Ltd.			1,576,749	14,291,028	2.1
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Nestle SA (REG)			151,065	18,659,275	2.7
				<u>32,950,303</u>	<u>4.8</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
International Flavors & Fragrances, Inc.			104,835	14,851,974	2.2
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
American Tower Corp.			54,027	13,801,737	2.0
Gesamtanlagen				<u>\$ 658,415,646</u>	<u>96.2%</u>
Termineinlagen					
BNP Paribas, Paris(a)	(0.53)%	—		67,663	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	(0.13)%	—		66,713	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	0.00 %	—		1	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(a)	(1.44)%	—		68,198	0.0
DBS Bank Ltd, Singapore(a)	0.01 %	—		20,991,308	3.1
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(a)	0.00 %	—		66,884	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(a)	(0.78)%	—		306,640	0.1
Sumitomo, London(a)	0.01 %	—		66,417	0.0
Sumitomo, Tokyo(a)	(0.29)%	—		5,900	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>21,639,724</u>	<u>3.2</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>4,124,744</u>	<u>0.6</u>
Nettovermögen				<u>\$ 684,180,114</u>	<u>100.0%</u>

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	USD 9,936	SEK 84,934	07/15/2021	\$ 295,253
Bank of America, NA	JPY 211,520	USD 1,947	08/19/2021	20,057
Barclays Bank PLC	USD 12,477	GBP 9,049	06/17/2021	365,505
Barclays Bank PLC	CNH 79,070	USD 12,124	06/24/2021	(290,826)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 5,461	CNH 35,491	06/24/2021	111,650
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 7,304	DKK 44,891	07/15/2021	62,292
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 2,758	CHF 2,512	08/05/2021	39,337
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 126	SGD 167	06/21/2021	995
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 177	CAD 214	06/30/2021	503
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 213	CHF 191	06/30/2021	(640)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,695	EUR 5,476	06/30/2021	(14,187)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,416	GBP 1,001	06/30/2021	4,537
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 128	SGD 169	06/30/2021	207
Citibank, NA	GBP 3,717	USD 5,172	06/17/2021	(102,972)
Goldman Sachs Bank USA	CNH 33,035	USD 5,111	06/24/2021	(76,172)
Goldman Sachs Bank USA	USD 2,324	CNH 14,957	06/24/2021	24,733
Goldman Sachs Bank USA	SEK 18,986	USD 2,271	07/15/2021	(16,092)
Goldman Sachs Bank USA	USD 33,599	CAD 42,071	07/16/2021	1,224,811
HSBC Bank USA	DKK 18,449	USD 2,993	07/15/2021	(34,558)
HSBC Bank USA	EUR 31,353	USD 38,461	08/03/2021	181,093
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 2,115	GBP 1,495	06/17/2021	6,549
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD 1,773	DKK 10,888	07/15/2021	13,434
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 2,003	USD 2,451	08/03/2021	5,057

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY	3,183,716	USD	29,264	08/19/2021	\$ 260,553
Standard Chartered Bank	DKK	140,695	USD	22,617	07/15/2021	(469,638)
UBS AG	GBP	1,404	USD	1,976	06/17/2021	(16,665)
UBS AG	CAD	13,802	USD	11,169	07/16/2021	(255,526)
						<u>\$ 1,339,290</u>
					Wertsteigerung	\$ 2,616,566
					Wertminderung	\$ (1,277,276)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
IPG Photonics Corp.	52,329	\$ 10,950,367	0.6%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Akamai Technologies, Inc.	128,039	14,623,334	0.9
Automatic Data Processing, Inc.	112,516	22,055,387	1.3
Cognizant Technology Solutions Corp. - Class A	590,850	42,281,226	2.4
Visa, Inc. - Class A	108,461	24,653,185	1.4
		<u>103,613,132</u>	<u>6.0</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Applied Materials, Inc.	219,027	30,254,199	1.8
SOFTWARE			
Microsoft Corp.	316,927	79,130,333	4.6
SAP SE	331,559	46,422,814	2.7
Trend Micro, Inc./Japan	252,407	12,818,759	0.7
VMware, Inc. - Class A(a)	149,406	23,589,713	1.4
		<u>161,961,619</u>	<u>9.4</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	778,229	55,861,467	3.2
		<u>362,640,784</u>	<u>21.0</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
ABN AMRO Bank NV (GDR)	929,470	12,445,525	0.7
Jyske Bank A/S	435,684	22,486,258	1.3
Wells Fargo & Co.	365,149	17,059,761	1.0
		<u>51,991,544</u>	<u>3.0</u>
KAPITALMÄRKTE			
BlackRock, Inc. - Class A	31,105	27,280,329	1.6
CME Group, Inc. - Class A	72,211	15,796,878	0.9
Credit Suisse Group AG (REG)	1,704,419	18,623,664	1.1
Euronext NV	109,386	11,623,078	0.7
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	69,523	25,863,947	1.5
Julius Baer Group Ltd.	545,148	37,039,725	2.1
London Stock Exchange Group PLC	127,912	13,725,157	0.8
Moody's Corp.	110,922	37,197,693	2.1
Singapore Exchange Ltd.	1,149,185	9,020,531	0.5
		<u>196,171,002</u>	<u>11.3</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
American Express Co.	250,194	40,063,565	2.3
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Groupe Bruxelles Lambert SA	129,480	14,691,795	0.9
VERSICHERUNGEN			
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	13,176,765	12,861,507	0.7
		<u>315,779,413</u>	<u>18.2</u>
GESUNDHEITSWESSEN			
GESUNDHEITSWESSEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Koninklijke Philips NV	512,658	28,968,447	1.7
Medtronic PLC	273,662	34,642,873	2.0
		<u>63,611,320</u>	<u>3.7</u>
GESUNDHEITSWESSEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Anthem, Inc.	176,582	70,318,484	4.0
Henry Schein, Inc.	176,658	13,433,074	0.8
		<u>83,751,558</u>	<u>4.8</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Thermo Fisher Scientific, Inc.	45,066	21,158,487	1.2
PHARMAZEUTIKA			
AstraZeneca PLC (Sponsored ADR)(a)	424,927	24,123,106	1.4
Roche Holding AG	127,976	44,798,211	2.6
Sanofi	353,629	37,835,942	2.2
		<u>106,757,259</u>	<u>6.2</u>
		<u>275,278,624</u>	<u>15.9</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
Toyota Motor Corp.	199,000	16,514,786	0.9

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Service Corp. International/US	620,247	\$ 32,885,496	1.9%
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Compass Group PLC	932,049	21,246,521	1.2
Galaxy Entertainment Group Ltd.	2,578,000	21,600,731	1.3
		<u>42,847,252</u>	<u>2.5</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	152,367	32,600,443	1.9
Amazon.com, Inc.	12,928	41,667,849	2.4
Naspers Ltd. - Class N	216,665	47,758,812	2.8
Prosus NV	172,057	17,825,705	1.0
		<u>139,852,809</u>	<u>8.1</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
adidas AG	9,134	3,331,038	0.2
EssilorLuxottica SA	55,510	9,638,122	0.6
Kering SA	13,637	12,488,739	0.7
		<u>25,457,899</u>	<u>1.5</u>
		<u>257,558,242</u>	<u>14.9</u>
INDUSTRIEGÜTER			
BAUPRODUKTE			
Otis Worldwide Corp.	676,676	53,004,031	3.1
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Secom Co., Ltd.	291,376	23,030,650	1.3
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Vertiv Holdings Co.	455,312	11,300,844	0.6
INDUSTRIEKONZERNE			
3M Co.	161,362	32,762,940	1.9
MASCHINEN			
Dover Corp.	182,973	27,537,436	1.6
Volvo AB - Class B	834,339	21,989,113	1.3
		<u>49,526,549</u>	<u>2.9</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
RELX PLC	673,587	17,649,798	1.0
		<u>187,274,812</u>	<u>10.8</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Comcast Corp. - Class A	466,410	26,743,950	1.5
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	91,218	13,037,789	0.8
Nintendo Co., Ltd.	14,959	9,262,848	0.5
		<u>22,300,637</u>	<u>1.3</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	27,262	65,743,949	3.8
Facebook, Inc. - Class A	162,025	53,262,478	3.1
		<u>119,006,427</u>	<u>6.9</u>
		<u>168,051,014</u>	<u>9.7</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Asahi Group Holdings Ltd.	634,983	30,694,784	1.8
Coca-Cola Co. (The)	578,076	31,961,822	1.8
		<u>62,656,606</u>	<u>3.6</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Danone SA	199,571	14,226,358	0.8
		<u>76,882,964</u>	<u>4.4</u>
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
LUKOIL PJSC (Sponsored ADR)	189,075	15,359,606	0.9
Neste Oyj	164,995	10,882,550	0.6
		<u>26,242,156</u>	<u>1.5</u>
IMMOBILIEN			
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
CBRE Group, Inc. - Class A	290,152	25,469,543	1.5
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Linde PLC	75,457	22,682,374	1.3%

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
Iberdrola SA			693,580	\$ 9,560,307	0.6%
Gesamtanlagen				<u>\$ 1,727,420,233</u>	<u>99.8%</u>
Termineinlagen					
BNP Paribas, Paris(b)	(0.53)%	—		128	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.00 %	—		69,888	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.01 %	—		2,816,291	0.2
BNP Paribas, Paris(b)	2.99 %	—		624,817	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.44)%	—		170,813	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	—		171,154	0.0
Nordea Bank Abp, Oslo(b)	(0.78)%	—		978,374	0.1
SEB, Stockholm(b)	(0.28)%	—		166,362	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	—		764,378	0.0
Sumitomo, London(b)	(0.29)%	—		<u>169,353</u>	<u>0.0</u>
Termineinlagen insgesamt				<u>5,931,558</u>	<u>0.3</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(2,171,452)</u>	<u>(0.1)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 1,731,180,339</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	21,140	USD	16,398	06/01/2021	\$ 101,148
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF	1	USD	1	06/01/2021	(5)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF	15	USD	17	06/01/2021	49
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	359	USD	435	06/01/2021	(2,669)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	6,507	USD	7,951	06/01/2021	16,679
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	18,905	USD	26,736	06/01/2021	(92,705)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NOK	442,684	USD	53,148	06/01/2021	214,482
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	25	USD	19	06/01/2021	(36)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	16,414	AUD	21,140	06/01/2021	(117,064)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	17	CHF	15	06/01/2021	240
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	84	EUR	69	06/01/2021	(245)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	8,221	EUR	6,797	06/01/2021	66,919
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	26,299	GBP	18,905	06/01/2021	530,338
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	53,705	NOK	442,684	06/01/2021	(771,727)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	19	SGD	25	06/01/2021	51
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	1,845	USD	1,426	06/21/2021	4,082
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF	2,514	USD	2,787	06/21/2021	(9,045)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CHF	35	USD	39	06/21/2021	0
Brown Brothers Harriman & Co.+	DKK	79	USD	13	06/21/2021	(16)
Brown Brothers Harriman & Co.+	DKK	4,139	USD	680	06/21/2021	1,024
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	183	USD	224	06/21/2021	(262)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	6,351	USD	7,759	06/21/2021	12,018
Brown Brothers Harriman & Co.+	GBP	739	USD	1,046	06/21/2021	(2,597)
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD	7,565	USD	974	06/21/2021	(448)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY	286,863	USD	2,629	06/21/2021	16,974
Brown Brothers Harriman & Co.+	SEK	5,556	USD	667	06/21/2021	(1,948)
Brown Brothers Harriman & Co.+	SGD	357	USD	268	06/21/2021	(2,138)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	16,556	AUD	21,398	06/21/2021	(58,880)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	49	CHF	44	06/21/2021	(146)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	46	CHF	41	06/21/2021	61
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	12	DKK	72	06/21/2021	(5)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	19	DKK	114	06/21/2021	6
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6,355	EUR	5,202	06/21/2021	(9,795)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	90	EUR	74	06/21/2021	103
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	11	GBP	7	06/21/2021	(10)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	22	GBP	16	06/21/2021	68
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10	HKD	76	06/21/2021	(1)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	28	HKD	214	06/21/2021	9
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	73	JPY	7,976	06/21/2021	(388)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6	SEK	53	06/21/2021	(32)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	45	SEK	375	06/21/2021	94
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	25	SGD	34	06/21/2021	147
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	37	ZAR	515	06/21/2021	(94)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	86	ZAR	1,203	06/21/2021	1,119
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR	20,400	USD	1,445	06/21/2021	(31,362)
Brown Brothers Harriman & Co.+	ZAR	332	USD	24	06/21/2021	25

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	10	USD	8	06/30/2021	\$ 50
Brown Brothers Harriman & Co.+	NOK	3,000	USD	359	06/30/2021	(198)
Brown Brothers Harriman & Co.+	NOK	8,930	USD	1,073	06/30/2021	4,957
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	14,076	AUD	18,143	06/30/2021	(88,220)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	16	CHF	15	06/30/2021	(50)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	7,823	EUR	6,398	06/30/2021	(16,650)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	2	EUR	2	06/30/2021	0
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	25,306	GBP	17,888	06/30/2021	80,523
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	50,201	NOK	418,182	06/30/2021	(194,855)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	18	SGD	24	06/30/2021	29
						<u>\$ (350,396)</u>
					Wertsteigerung	\$ 1,051,195
					Wertminderung	\$ (1,401,591)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
 CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
 DKK – Danish Krone
 EUR – Euro
 GBP – Great British Pound
 HKD – Hong Kong Dollar
 JPY – Japanese Yen
 NOK – Norwegian Krone
 SEK – Swedish Krona
 SGD – Singapore Dollar
 USD – United States Dollar
 ZAR – South African Rand

Glossar:

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Advanced Drainage Systems, Inc.....	5.00%	09/30/2027	USD	19	\$ 19,806 0.0%
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043		3	3,383 0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.....	4.63%	03/01/2029		20	20,549 0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.....	4.88%	03/01/2031		22	22,511 0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.....	9.88%	10/17/2025		50	58,528 0.1
Constellium SE	4.25%	02/15/2026	EUR	160	198,370 0.2
Element Solutions, Inc.	3.88%	09/01/2028	USD	46	46,134 0.0
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.....	4.50%	09/15/2027		72	78,127 0.1
Graham Packaging Co., Inc.	7.13%	08/15/2028		11	11,726 0.0
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027		46	49,483 0.0
Hecla Mining Co.....	7.25%	02/15/2028		176	193,392 0.2
Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV, Inc.	9.00%	07/01/2028		52	57,463 0.1
INEOS Group Holdings SA.....	5.38%	08/01/2024	EUR	155	190,396 0.2
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	USD	63	65,207 0.1
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	8.50%	08/01/2028		55	60,798 0.1
Nouryon Holding BV.....	6.50%	10/01/2026	EUR	100	127,455 0.1
Peabody Energy Corp.(a)	8.50%	12/31/2024	USD	49	30,985 0.0
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.....	10.00%	12/31/2024		54	52,245 0.1
Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030		47	48,031 0.0
WR Grace & Co.-Conn	4.88%	06/15/2027		41	43,187 0.0
					<u>1,377,776 1.3</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024		36	37,001 0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025		47	47,373 0.1
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027		34	34,510 0.0
Clean Harbors, Inc.	4.88%	07/15/2027		132	138,738 0.1
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029		45	48,666 0.1
Cleaver-Brooks, Inc.	7.88%	03/01/2023		31	31,059 0.0
Colfax Corp.....	6.38%	02/15/2026		15	15,826 0.0
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026		147	154,350 0.2
GFL Environmental, Inc.....	5.13%	12/15/2026		11	11,560 0.0
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028		10	10,565 0.0
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025		9	9,165 0.0
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027		12	12,356 0.0
OI European Group BV	3.13%	11/15/2024	EUR	325	410,340 0.4
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025		100	126,563 0.1
Signature Aviation US Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2028	USD	110	110,393 0.1
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.....	5.25%	01/15/2029		22	23,260 0.0
Tervita Corp.	11.00%	12/01/2025		51	57,304 0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024		41	41,799 0.1
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025		13	13,293 0.0
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024		32	35,422 0.0
Wesco Distribution, Inc.....	7.13%	06/15/2025		20	21,606 0.0
Wesco Distribution, Inc.....	7.25%	06/15/2028		13	14,417 0.0
					<u>1,405,566 1.3</u>
KOMMUNIKATIONS MEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.....	6.50%	11/15/2028		116	123,104 0.1
AMC Networks, Inc.	4.25%	02/15/2029		111	110,218 0.1
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028		20	20,436 0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030		52	52,978 0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033		186	185,740 0.2
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.50%	05/01/2026		50	51,680 0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.75%	02/15/2026		3	3,102 0.0
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027		51	51,455 0.1
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026		78	88,590 0.1
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026		3	3,547 0.0
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027		6	6,447 0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029		8	8,418 0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027		224	239,707 0.2
Meredith Corp.....	6.88%	02/01/2026		49	51,196 0.1
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028		84	80,189 0.1
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.....	4.63%	03/15/2030		35	34,901 0.0
Scripps Escrow, Inc.....	5.88%	07/15/2027		50	51,719 0.1
Scripps Escrow II, Inc.....	5.38%	01/15/2031		51	51,151 0.0
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030		49	48,952 0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029		3	3,237 0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029		135	137,961 0.1
Univision Communications, Inc.....	5.13%	02/15/2025		15	15,262 0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	USD 33	\$ 35,761	0.0%
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025	31	34,226	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	230	234,062	0.2
				<u>1,724,039</u>	<u>1.6</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	86	92,972	0.1
Frontier Communications Holdings LLC	6.75%	05/01/2029	24	25,045	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	9	9,995	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(b)	5.50%	08/01/2023	41	23,946	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(b)	8.50%	10/15/2024	40	23,825	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	3	3,930	0.0
Zayo Group Holdings, Inc.	6.13%	03/01/2028	90	91,604	0.1
				<u>271,317</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025	68	75,136	0.1
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029	8	8,700	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	55	59,684	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	EUR 100	126,246	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	USD 15	16,017	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028	177	186,859	0.2
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025	18	21,991	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a)	3.63%	05/15/2025	EUR 100	124,261	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	3.75%	09/15/2026	320	399,582	0.4
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	220	291,709	0.3
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	USD 33	35,112	0.0
PM General Purchaser LLC	9.50%	10/01/2028	31	33,893	0.0
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2026	85	84,379	0.1
Tenneco, Inc.	7.88%	01/15/2029	24	26,900	0.0
				<u>1,490,469</u>	<u>1.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Boyne USA, Inc.	4.75%	05/15/2029	33	34,005	0.0
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	100	106,250	0.1
Carnival Corp.	9.88%	08/01/2027	31	36,270	0.1
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023	132	150,946	0.2
Cedar Fair LP	5.25%	07/15/2029	3	3,055	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.50%	05/01/2025	207	216,242	0.2
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	118	129,259	0.1
Mattel, Inc.	6.75%	12/31/2025	4	4,209	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	117	134,257	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	204	236,130	0.2
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025	130	140,663	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	9.50%	08/01/2025	76	82,003	0.1
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	42	45,262	0.1
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	29	30,916	0.0
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5.63%	02/15/2029	31	31,416	0.0
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	54	54,405	0.1
				<u>1,435,288</u>	<u>1.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	73	76,818	0.1
Bally's Corp.	6.75%	06/01/2027	55	58,475	0.1
Boyd Gaming Corp.	8.63%	06/01/2025	17	18,725	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	16	15,749	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	132	139,289	0.1
Empire Communities Corp.	7.00%	12/15/2025	36	38,184	0.0
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025	60	63,418	0.1
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp.	6.50%	07/15/2025	28	30,176	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029	35	35,374	0.0
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	10	10,525	0.0
K. Hovnanian Enterprises, Inc.	10.00%	07/15/2022	86	86,533	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	53	56,361	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC	6.50%	09/15/2026	14	14,586	0.0
Mattamy Group Corp.	5.25%	12/15/2027	73	76,081	0.1
Samsonite Finco SARL	3.50%	05/15/2026	EUR 118	140,158	0.1
Scientific Games International, Inc.	3.38%	02/15/2026	100	121,960	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	USD 65	65,102	0.1
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp.	5.88%	05/15/2025	37	36,409	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	USD 79	\$ 88,734	0.1%
Travel + Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	49	56,098	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025	3	3,198	0.0
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	66	68,752	0.1
				<u>1,300,705</u>	<u>1.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	5.75%	04/15/2025	34	36,028	0.1
IRB Holding Corp.	6.75%	02/15/2026	108	111,780	0.1
				<u>147,808</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Burlington Coat Factory Warehouse Corp.	6.25%	04/15/2025	13	14,028	0.0
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	33	34,129	0.0
Foundation Building Materials, Inc.	6.00%	03/01/2029	27	26,473	0.0
L Brands, Inc.	5.25%	02/01/2028	14	15,215	0.0
L Brands, Inc.	6.75%	07/01/2036	35	41,718	0.0
L Brands, Inc.	6.88%	11/01/2035	40	48,167	0.1
L Brands, Inc.	6.95%	03/01/2033	4	4,671	0.0
L Brands, Inc.	7.50%	06/15/2029	14	16,158	0.0
LBM Acquisition LLC.	6.25%	01/15/2029	15	15,337	0.0
Magic Mergeco, Inc.	5.25%	05/01/2028	49	49,568	0.1
Magic Mergeco, Inc.	7.88%	05/01/2029	104	106,056	0.1
Penske Automotive Group, Inc.	3.50%	09/01/2025	45	46,336	0.0
Rite Aid Corp.	7.50%	07/01/2025	56	58,169	0.1
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	65	67,769	0.1
SRS Distribution, Inc.	6.13%	07/01/2029	14	14,280	0.0
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	104	107,896	0.1
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024	46	50,567	0.1
				<u>716,537</u>	<u>0.7</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Acadia Healthcare Co., Inc.	5.50%	07/01/2028	41	43,519	0.1
AdaptHealth LLC.	4.63%	08/01/2029	47	46,134	0.1
AdaptHealth LLC.	6.13%	08/01/2028	25	26,334	0.0
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	59	63,317	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	6.13%	04/15/2025	33	33,704	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	9	9,607	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.63%	02/15/2025	45	47,336	0.1
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	14	13,747	0.0
Endo Luxembourg Finance Co. I Sarl/Endo US, Inc.	6.13%	04/01/2029	38	37,428	0.0
Grifols SA	3.20%	05/01/2025	EUR 434	533,478	0.5
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	5.00%	12/31/2026	USD 74	75,255	0.1
Legacy LifePoint Health LLC	4.38%	02/15/2027	23	22,942	0.0
MEDNAX, Inc.	6.25%	01/15/2027	3	3,182	0.0
ModivCare, Inc.	5.88%	11/15/2025	19	20,049	0.0
Post Holdings, Inc.	4.63%	04/15/2030	105	105,702	0.1
Radiology Partners, Inc.	9.25%	02/01/2028	67	73,443	0.1
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc.	9.75%	12/01/2026	125	134,728	0.1
Triton Water Holdings, Inc.	6.25%	04/01/2029	29	29,076	0.0
US Acute Care Solutions LLC.	6.38%	03/01/2026	15	15,524	0.0
US Foods, Inc.	4.75%	02/15/2029	91	90,712	0.1
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	29	30,208	0.0
				<u>1,455,425</u>	<u>1.4</u>
ENERGIE					
Antero Resources Corp.	8.38%	07/15/2026	33	37,225	0.0
Apache Corp.	4.63%	11/15/2025	13	13,803	0.0
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026	61	60,352	0.1
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	51	55,162	0.1
Bonanza Creek Energy, Inc.	7.50%	04/30/2026	2	1,605	0.0
Callon Petroleum, Co.	6.25%	04/15/2023	29	27,467	0.0
Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024	31	31,778	0.0
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	37	38,466	0.0
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	78	83,165	0.1
Comstock Resources, Inc.	9.75%	08/15/2026	31	33,615	0.0
EnLink Midstream LLC.	5.63%	01/15/2028	115	119,722	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024	8	8,302	0.0
EQT Corp.	3.90%	10/01/2027	5	5,341	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024	51	51,058	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	150	150,802	0.2
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	41	44,288	0.1
Gulfport Energy Corp.	8.00%	05/17/2026	33	36,746	0.0
Hess Midstream Operations LP	5.63%	02/15/2026	138	143,450	0.1
Independence Energy Finance LLC.	7.25%	05/01/2026	54	54,735	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	52	46,268	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028	50	42,485	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Nabors Industries, Inc.	5.75%	02/01/2025	USD 33	\$ 27,376	0.0%
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	78	79,206	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	142	147,670	0.1
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023	47	45,786	0.1
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023	99	99,654	0.1
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	23	24,914	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.00%	07/15/2025	39	45,779	0.1
Occidental Petroleum Corp.	8.50%	07/15/2027	18	21,905	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	18	23,080	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	9.25%	05/15/2025	101	103,927	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	38	38,869	0.0
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023	9	9,277	0.0
Renewable Energy Group, Inc.	5.88%	06/01/2028	14	14,565	0.0
SM Energy Co.	5.63%	06/01/2025	7	6,698	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028	39	41,066	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	6.00%	04/15/2027	5	5,220	0.0
Targa Resources Partners LP/ Targa Resources Partners Finance Corp.	4.00%	01/15/2032	111	110,099	0.1
Transocean Pontus Ltd.	6.13%	08/01/2025	22	22,292	0.0
Transocean, Inc.	7.50%	01/15/2026	12	9,419	0.0
Transocean, Inc.	8.00%	02/01/2027	75	56,902	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	8	8,315	0.0
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022	16	16,365	0.0
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	45	48,368	0.1
Western Midstream Operating LP	5.30%	02/01/2030	38	41,888	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	13	13,468	0.0
				<u>2,147,943</u>	<u>2.0</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	38	40,135	0.1
Belden, Inc.	2.88%	09/15/2025	EUR 440	540,645	0.5
IAA, Inc.	5.50%	06/15/2027	USD 3	3,151	0.0
Interface, Inc.	5.50%	12/01/2028	23	24,058	0.0
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025	3	3,065	0.0
				<u>611,054</u>	<u>0.6</u>
DIENTSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	35	37,163	0.0
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027	68	74,977	0.1
ANGI Group LLC	3.88%	08/15/2028	37	36,315	0.0
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	154	163,084	0.2
APX Group, Inc.	7.88%	12/01/2022	29	29,133	0.0
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025	55	58,451	0.1
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	51	54,170	0.1
eDreams ODIGEO SA.	5.50%	09/01/2023	EUR 100	121,278	0.1
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027	USD 50	55,332	0.1
Gartner, Inc.	4.50%	07/01/2028	50	52,585	0.0
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	87	86,555	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	3.38%	08/31/2027	27	25,934	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	3	3,195	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	106	109,532	0.1
Service Corp. International/US	3.38%	08/15/2030	36	34,953	0.0
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	26	28,012	0.0
				<u>970,669</u>	<u>0.9</u>
TECHNOLOGIE					
Austin BidCo, Inc.	7.13%	12/15/2028	22	21,988	0.0
Avaya, Inc.	6.13%	09/15/2028	123	130,482	0.1
Banff Merger Sub, Inc.	9.75%	09/01/2026	97	102,732	0.1
Boxer Parent Co., Inc.	6.50%	10/02/2025	EUR 100	129,881	0.1
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	USD 17	17,876	0.0
CommScope, Inc.	8.25%	03/01/2027	42	44,844	0.1
Microchip Technology, Inc.	4.25%	09/01/2025	21	22,040	0.0
NCR Corp.	5.13%	04/15/2029	73	74,880	0.1
NCR Corp.	8.13%	04/15/2025	31	33,776	0.0
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	7	7,192	0.0
Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028	7	7,626	0.0
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	12	12,451	0.0
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	138	142,889	0.2
				<u>748,657</u>	<u>0.7</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	58	61,152	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	25	28,604	0.0
				<u>89,756</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	USD 34	\$ 35,807	0.0%
Modulaire Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023	200	203,807	0.2
				<u>239,614</u>	<u>0.2</u>
				<u>16,132,623</u>	<u>15.3</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Alliance Data Systems Corp.	4.75%	12/15/2024	123	126,765	0.1
Alliance Data Systems Corp.	7.00%	01/15/2026	17	18,254	0.0
Ally Financial, Inc., Series B(c)	4.70%	05/15/2026	140	143,818	0.2
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(c)	5.88%	09/24/2023	EUR 200	262,750	0.3
Banco Santander SA(c)	6.75%	04/25/2022	400	510,444	0.5
Citizens Financial Group, Inc., Series A(c) (d)	4.15%	07/06/2021	USD 10	9,994	0.0
Credit Suisse Group AG(c)	6.25%	12/18/2024	200	217,973	0.2
Credit Suisse Group AG(c)	7.50%	07/17/2023	221	238,378	0.2
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	100	142,379	0.1
Societe Generale SA(c)	7.38%	09/13/2021	230	233,767	0.2
				<u>1,904,522</u>	<u>1.8</u>
MAKLER					
NFP Corp.	6.88%	08/15/2028	45	46,550	0.0
NFP Corp.	7.00%	05/15/2025	46	50,427	0.1
				<u>96,977</u>	<u>0.1</u>
FINANZEN					
Compass Group Diversified Holdings LLC	5.25%	04/15/2029	48	49,505	0.0
Enova International, Inc.	8.50%	09/01/2024	18	18,439	0.0
Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	50	51,984	0.1
goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024	82	84,781	0.1
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	EUR 111	137,065	0.1
Navient Corp.	6.50%	06/15/2022	USD 32	33,505	0.0
				<u>375,279</u>	<u>0.3</u>
VERSICHERUNGEN					
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	7.00%	11/15/2025	61	62,372	0.1
Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	10.13%	08/01/2026	42	47,323	0.0
Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer.	6.75%	10/15/2027	54	55,714	0.1
AssuredPartners, Inc.	5.63%	01/15/2029	84	83,758	0.1
HUB International Ltd.	7.00%	05/01/2026	25	25,909	0.0
				<u>275,076</u>	<u>0.3</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Intrum AB	2.75%	07/15/2022	EUR 16	19,511	0.0
Intrum AB	3.00%	09/15/2027	100	120,016	0.1
Intrum AB	4.88%	08/15/2025	105	134,770	0.2
				<u>274,297</u>	<u>0.3</u>
REITS					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Selco LL	5.75%	05/15/2026	USD 61	64,050	0.1
Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	75	83,260	0.1
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2027	3	3,107	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	15	15,517	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	43	44,943	0.0
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.75%	02/01/2027	65	72,187	0.1
Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/ PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	29	30,064	0.0
Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	9.38%	04/01/2027	100	111,372	0.1
				<u>424,500</u>	<u>0.4</u>
				<u>3,350,651</u>	<u>3.2</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027	3	3,113	0.0
Talen Energy Supply LLC	7.25%	05/15/2027	43	43,952	0.0
Talen Energy Supply LLC	10.50%	01/15/2026	74	67,340	0.1
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	3	3,118	0.0
				<u>117,523</u>	<u>0.1</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	44	46,091	0.0
				<u>163,614</u>	<u>0.1</u>
				<u>19,646,888</u>	<u>18.6</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
AUSTRALIEN						
	Australia Government Bond, Series 163	1.00%	11/21/2031	AUD 2,868	\$ 2,066,513	2.0%
CHINA						
	China Government Bond, Series 1916	3.12%	12/05/2026	CNY 8,560	1,353,191	1.3
KOLUMBIEN						
	Colombian TES, Series B	7.00%	06/30/2032	COP 2,613,900	675,829	0.6
MEXIKO						
	Mexican Bonos, Series M 20	7.50%	06/03/2027	MXN 25,291	1,342,767	1.3
PERU						
	Peru Government Bond	6.95%	08/12/2031	PEN 3,849	1,180,249	1.1
RUSSLAND						
	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6227	7.40%	07/17/2024	RUB 72,142	1,014,087	1.0
VEREINIGTE STAATEN						
	U.S. Treasury Bonds(e)	6.00%	02/15/2026	USD 742	921,893	0.9
	U.S. Treasury Bonds	6.38%	08/15/2027	567	748,129	0.7
	U.S. Treasury Bonds(f)	6.50%	11/15/2026	5,615	7,281,694	6.9
	U.S. Treasury Bonds	6.75%	08/15/2026	437	567,443	0.5
					9,519,159	9.0
					17,151,795	16.3
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
	AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	501	544,125	0.5
	Ally Financial, Inc.	5.80%	05/01/2025	20	23,376	0.0
	American Express Co., Series C(c) (d)	3.47%	09/15/2021	35	34,900	0.0
	Banco de Credito del Peru	3.13%	07/01/2030	89	87,443	0.1
	Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca					
	Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025	214	242,529	0.2
	Bank of America Corp., Series DD(c)	6.30%	03/10/2026	129	149,525	0.2
	Bank of America Corp., Series X(c)	6.25%	09/05/2024	190	210,898	0.2
	Bank of America Corp., Series Z(c)	6.50%	10/23/2024	61	69,369	0.1
	Bank of New York Mellon Corp. (The), Series E(c) (d)	3.61%	09/20/2021	42	42,163	0.0
	Barclays Bank PLC	10.18%	06/12/2021	91	91,240	0.1
	BNP Paribas SA(c)	6.75%	03/14/2022	200	207,282	0.2
	CIT Group, Inc.	3.93%	06/19/2024	32	33,887	0.0
	Citigroup, Inc.(c)	3.88%	02/18/2026	60	60,467	0.1
	Citigroup, Inc.(c)	5.95%	01/30/2023	77	81,045	0.1
	Citigroup, Inc., Series T(c)	6.25%	08/15/2026	60	69,788	0.1
	Citigroup, Inc., Series U(c)	5.00%	09/12/2024	110	115,026	0.1
	Citigroup, Inc., Series W(c)	4.00%	12/10/2025	42	42,828	0.0
	Erste Group Bank AG(c)	8.88%	10/15/2021	EUR 200	251,722	0.2
	Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(c)	5.30%	11/10/2026	USD 6	6,616	0.0
	Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(c)	5.00%	11/10/2022	41	41,226	0.0
	HSBC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	INR 10,000	140,974	0.1
	HSBC Holdings PLC(c)	6.00%	09/29/2023	EUR 302	403,837	0.4
	ING Groep NV(c)	6.50%	04/16/2025	USD 328	364,477	0.4
	ING Groep NV(c)	6.75%	04/16/2024	250	274,988	0.3
	Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	06/27/2024	217	245,076	0.2
	Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	39	43,797	0.1
	Standard Chartered PLC(c)	7.50%	04/02/2022	200	208,964	0.2
	UBS Group AG(c)	7.13%	08/10/2021	229	231,388	0.2
	UniCredit SpA	7.83%	12/04/2023	350	405,951	0.4
	UniCredit SpA, Series E	6.95%	10/31/2022	EUR 136	181,400	0.2
					4,906,307	4.7
MAKLER						
	Charles Schwab Corp. (The), Series G(c)	5.38%	06/01/2025	USD 139	153,762	0.1
FINANZEN						
	AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025	151	176,411	0.2
	Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	19	18,685	0.0
	Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	17	18,101	0.0
	Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	3	3,249	0.0
	Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023	38	40,729	0.1
	Aircastle Ltd.	5.00%	04/01/2023	3	3,213	0.0
	Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	126	140,382	0.1
	Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	4	3,981	0.0
	Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022	16	16,177	0.0
	Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	33	34,552	0.0
	Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023	74	77,553	0.1
	Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	41	44,094	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	USD 35	\$ 37,591	0.0%
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	35	38,659	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	105	118,418	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	200	138,500	0.1
Synchrony Financial	4.25%	08/15/2024	27	29,596	0.0
Synchrony Financial	4.38%	03/19/2024	38	41,636	0.1
				<u>981,527</u>	<u>0.9</u>
VERSICHERUNGEN					
Allstate Corp. (The), Series B	5.75%	08/15/2053	188	202,360	0.2
ASR Nederland NV	3.38%	05/02/2049	EUR 170	230,820	0.2
Assicurazioni Generali SpA, Series E	5.50%	10/27/2047	220	326,105	0.3
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(d)	2.28%	02/12/2047	USD 195	187,456	0.2
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	100	138,122	0.1
MetLife, Inc.	6.40%	12/15/2036	7	8,908	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	29	31,156	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	78	84,313	0.1
Prudential Financial, Inc.	5.88%	09/15/2042	200	211,685	0.2
Voya Financial, Inc.	5.65%	05/15/2053	243	258,308	0.3
				<u>1,679,233</u>	<u>1.6</u>
REITS					
Brixmor Operating Partnership LP	4.05%	07/01/2030	46	50,692	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	63	71,175	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026	32	36,573	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	23	24,511	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027	9	9,487	0.0
Sabra Health Care LP	4.80%	06/01/2024	88	96,503	0.1
Spirit Realty LP	4.45%	09/15/2026	40	44,825	0.0
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	240	264,495	0.3
VEREIT Operating Partnership LP	3.40%	01/15/2028	55	59,497	0.1
VEREIT Operating Partnership LP	4.63%	11/01/2025	28	31,871	0.0
VEREIT Operating Partnership LP	4.88%	06/01/2026	10	11,554	0.0
				<u>701,183</u>	<u>0.7</u>
				<u>8,422,012</u>	<u>8.0</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Anglo American Capital PLC	5.38%	04/01/2025	208	238,864	0.2
ArcelorMittal SA	7.00%	03/01/2041	35	47,555	0.1
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	25	26,685	0.0
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	37	38,379	0.0
				<u>351,483</u>	<u>0.3</u>
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co.	3.45%	05/01/2027	10	11,024	0.0
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	3.20%	06/15/2025	13	13,878	0.0
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	4.40%	03/15/2024	18	19,617	0.1
				<u>44,519</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Omnicom Group, Inc.	4.20%	06/01/2030	28	31,816	0.0
Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024	205	216,056	0.2
				<u>247,872</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Financial Co., Inc.	2.20%	04/01/2024	EUR 450	580,117	0.6
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.88%	05/19/2023	235	307,845	0.3
Hyundai Capital America	5.88%	04/07/2025	USD 293	340,759	0.3
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	26	27,694	0.1
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027	25	27,575	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp.	2.60%	09/28/2022	10	10,232	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp.	2.80%	01/13/2022	6	6,078	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp.	3.45%	03/15/2023	9	9,407	0.0
				<u>1,309,707</u>	<u>1.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Lennar Corp.	4.75%	11/29/2027	3	3,470	0.0
Marriott International, Inc./MD, Series EE	5.75%	05/01/2025	33	38,305	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	30	38,129	0.0
Standard Industries, Inc./NJ	4.38%	07/15/2030	45	45,533	0.1
				<u>125,437</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
PVH Corp.	3.13%	12/15/2027	EUR 430	593,292	0.5
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027	USD 55	63,952	0.1
				<u>657,244</u>	<u>0.6</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE						
	Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	USD 66	\$ 75,333	0.1%
	Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	97	113,778	0.1
	Ecopetrol SA	5.88%	09/18/2023	6	6,480	0.0
	Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045	10	10,325	0.0
	Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	93	109,856	0.1
	Energy Transfer LP	3.90%	07/15/2026	12	13,128	0.0
	Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	121	163,721	0.2
	Kinder Morgan, Inc., Series G	7.75%	01/15/2032	20	28,351	0.0
	ONEOK, Inc.	2.20%	09/15/2025	40	41,223	0.0
	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	30	33,619	0.0
	Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.65%	10/15/2025	71	79,384	0.1
	Tennessee Gas Pipeline Co.	7.00%	10/15/2028	82	105,351	0.1
					<u>780,549</u>	<u>0.7</u>
Dienstleistungen						
	Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	12	13,993	0.0
Technologie						
	Baidu, Inc.	3.08%	04/07/2025	295	312,472	0.3
	Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028	52	57,572	0.1
	Broadcom, Inc.	5.00%	04/15/2030	108	125,082	0.1
	CDW LLC/CDW Finance Corp.	4.13%	05/01/2025	34	35,540	0.0
					<u>530,666</u>	<u>0.5</u>
Transportwesen – Fluggesellschaften						
	Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	129	150,079	0.1
	Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	49	53,514	0.1
	Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	274	300,782	0.3
	Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025	214	245,428	0.2
					<u>749,803</u>	<u>0.7</u>
Transportwesen – Eisenbahnen						
	Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	269	275,053	0.3
					<u>5,086,326</u>	<u>4.8</u>
Versorgungsbetriebe						
Elektrizität						
	Empresas Publicas de Medellin ESP	4.38%	02/15/2031	200	195,040	0.2
					<u>13,703,378</u>	<u>13.0</u>
Besicherte Hypothekenverpflichtungen						
Risikoteilung – Variabel verzinslich						
	Bellemeade Re Ltd.					
	Series 2019-1A, Class M2(d)	2.79%	03/25/2029	162	162,451	0.2
	Series 2019-4A, Class M1C(d)	2.59%	10/25/2029	193	193,294	0.2
	Series 2020-2A, Class M1C(d)	4.09%	08/26/2030	222	225,934	0.2
	Connecticut Avenue Securities Trust, Series 2019-R01, Class 2M2(d)	2.54%	07/25/2031	109	109,953	0.1
	Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
	Series 2014-HQ3, Class M3(d)	4.84%	10/25/2024	168	169,554	0.2
	Series 2015-HQA2, Class B(d)	10.59%	05/25/2028	373	419,364	0.4
	Series 2016-DNA1, Class B(d)	10.09%	07/25/2028	247	278,663	0.3
	Series 2016-DNA2, Class M3(d)	4.74%	10/25/2028	171	179,023	0.2
	Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
	Series 2014-C01, Class M2(d)	4.49%	01/25/2024	71	72,212	0.1
	Series 2014-C02, Class 1M2(d)	2.69%	05/25/2024	54	53,970	0.1
	Series 2014-C04, Class 1M2(d)	4.99%	11/25/2024	45	46,027	0.0
	Series 2014-C04, Class 2M2(d)	5.09%	11/25/2024	56	57,396	0.1
	Series 2015-C02, Class 1M2(d)	4.09%	05/25/2025	629	643,518	0.6
	Series 2015-C02, Class 2M2(d)	4.09%	05/25/2025	31	31,693	0.0
	Series 2015-C03, Class 1M2(d)	5.09%	07/25/2025	101	104,114	0.1
	Series 2015-C03, Class 2M2(d)	5.09%	07/25/2025	28	28,414	0.0
	Series 2015-C04, Class 1M2(d)	5.79%	04/25/2028	83	87,959	0.1
	Series 2015-C04, Class 2M2(d)	5.64%	04/25/2028	238	250,962	0.2
	Series 2016-C02, Class 1M2(d)	6.09%	09/25/2028	6	6,385	0.0
	Series 2016-C05, Class 2B(d)	10.84%	01/25/2029	269	318,415	0.3
	Series 2017-C02, Class 2B1(d)	5.59%	09/25/2029	195	212,044	0.2
	Series 2017-C06, Class 1M2(d)	2.74%	02/25/2030	366	373,033	0.4
	Series 2017-C06, Class 2M2(d)	2.89%	02/25/2030	306	312,846	0.3
	Series 2017-C07, Class 1M2(d)	2.49%	05/25/2030	347	351,977	0.3
	Series 2017-C07, Class 2M2(d)	2.59%	05/25/2030	471	478,131	0.5
	Series 2018-C05, Class 1B1(d)	4.34%	01/25/2031	152	157,425	0.1
	Home Re Ltd., Series 2020-1, Class M2(d)	5.34%	10/25/2030	150	153,602	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-1R, Class A(d)	2.09%	03/27/2024	USD 86	\$ 85,846	0.1%
Series 2019-2R, Class A(d)	2.84%	05/27/2023	139	137,796	0.1
Series 2019-3R, Class A(d)	2.79%	10/27/2022	49	48,964	0.0
Radnor Re Ltd., Series 2020-1, Class M1B(d)	1.54%	01/25/2030	150	149,910	0.1
Triangle Re Ltd., Series 2020-1, Class M1C(d)	4.59%	10/25/2030	150	151,747	0.1
				<u>6,052,622</u>	<u>5.7</u>
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3119, Class PI(d) (g)	7.10%	02/15/2036	65	16,736	0.0
Series 4125, Class SA(d) (g)	6.05%	11/15/2042	30	6,002	0.0
Series 4248, Class SL(d) (g)	5.95%	05/15/2041	37	6,595	0.0
Series 4735, Class SA(d) (g)	6.10%	12/15/2047	451	115,188	0.1
Series 4754, Class QS(d) (g)	6.05%	02/15/2048	605	125,301	0.1
Series 4767, Class SB(d) (g)	6.10%	03/15/2048	510	99,943	0.1
Series 4774, Class BS(d) (g)	6.10%	02/15/2048	1,464	271,250	0.3
Series 4774, Class SL(d) (g)	6.10%	04/15/2048	589	107,836	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2012-70, Class HS(d) (g)	5.91%	07/25/2042	23	4,442	0.0
Series 2013-4, Class ST(d) (g)	6.06%	02/25/2043	133	26,865	0.0
Series 2014-88, Class BS(d) (g)	6.06%	01/25/2045	125	28,346	0.0
Series 2016-69, Class DS(d) (g)	6.01%	10/25/2046	1,502	253,997	0.3
Series 2017-20, Class SJ(d) (g)	6.01%	04/25/2047	635	145,226	0.1
Series 2017-49, Class SP(d) (g)	6.06%	07/25/2047	129	31,163	0.0
Series 2017-109, Class SJ(d) (g)	6.11%	01/25/2048	463	84,315	0.1
Series 2018-28, Class PS(d) (g)	6.11%	05/25/2048	597	124,358	0.1
Series 2018-30, Class SA(d) (g)	6.11%	05/25/2048	577	117,005	0.1
Series 2018-32, Class SB(d) (g)	6.11%	05/25/2048	263	62,538	0.1
Series 2018-45, Class SL(d) (g)	6.11%	06/25/2048	180	45,069	0.1
Series 2018-57, Class SL(d) (g)	6.11%	08/25/2048	675	128,827	0.1
Series 2018-58, Class SA(d) (g)	6.11%	08/25/2048	262	49,290	0.1
Series 2018-59, Class HS(d) (g)	6.11%	08/25/2048	695	130,599	0.1
				<u>1,980,891</u>	<u>1.9</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4981, Class MI(h)	5.00%	06/25/2050	1,408	253,459	0.3
Series 5013, Class JI(h)	4.00%	09/25/2050	637	80,773	0.1
Series 5015, Class BI(h)	4.00%	09/25/2050	100	17,944	0.0
Series 5018, Class AI(h)	4.00%	10/25/2050	81	14,575	0.0
Series 5018, Class GI(h)	4.50%	10/25/2050	104	16,092	0.0
Series 5024, Class DI(h)	4.00%	10/25/2050	1,210	189,471	0.2
Series 5030, Class EI(h)	3.50%	10/25/2050	85	15,479	0.0
Series 5036, Class IT(h)	4.00%	03/25/2050	1,555	249,011	0.2
Series 5043, Class IO(h)	5.00%	11/25/2050	104	19,532	0.0
Series 5049, Class CI(h)	3.50%	12/25/2050	2,121	305,763	0.3
Series 5052, Class IK(h)	4.00%	12/25/2050	1,482	225,278	0.2
Series 5080, Class IJ(h)	4.00%	12/25/2050	1,827	278,177	0.3
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2020-89, Class KI(h)	4.00%	12/25/2050	379	61,516	0.1
Series 2020-96, Class KI(h)	2.50%	01/25/2051	98	11,209	0.0
				<u>1,738,279</u>	<u>1.7</u>
				<u>9,771,792</u>	<u>9.3</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
KANADA					
Canada Housing Trust No. 1	1.95%	12/15/2025	CAD 6,250	5,381,175	5.1
Canada Housing Trust No. 1	2.90%	06/15/2024	3,415	3,015,593	2.9
				<u>8,396,768</u>	<u>8.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	USD 340	346,014	0.3
Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025	200	219,725	0.2
				<u>565,739</u>	<u>0.5</u>
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028	200	223,687	0.2
BRASILIEN					
Brazilian Government International Bond	2.88%	06/06/2025	200	205,800	0.2
COSTA RICA					
Costa Rica Government International Bond	7.16%	03/12/2045	303	318,775	0.3

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	USD 229	\$ 234,625	0.2%
Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	155	159,020	0.2
Dominican Republic International Bond	5.50%	01/27/2025	100	110,175	0.1
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	130	146,697	0.1
Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026	239	277,882	0.3
				<u>928,399</u>	<u>0.9</u>
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	17	9,578	0.0
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2030	60	51,900	0.0
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2035	283	197,751	0.2
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	23	14,681	0.0
				<u>273,910</u>	<u>0.2</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	6.13%	01/31/2022	200	205,350	0.2
Egypt Government International Bond	6.20%	03/01/2024	327	351,586	0.3
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	200	208,756	0.2
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	218	236,026	0.2
				<u>1,001,718</u>	<u>0.9</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	7.75%	01/24/2023	10	10,188	0.0
GHANA					
Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027	285	300,996	0.3
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	200	194,975	0.2
				<u>495,971</u>	<u>0.5</u>
HONDURAS					
Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	171	187,224	0.2
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR 177	218,446	0.2
KENIA					
Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	USD 250	275,125	0.3
LIBANON					
Lebanon Government International Bond(b)	6.65%	04/22/2024	29	3,803	0.0
Lebanon Government International Bond(b)	6.85%	03/23/2027	28	3,654	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(b)	1.00%	11/27/2026	144	18,972	0.0
				<u>26,429</u>	<u>0.0</u>
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.38%	07/12/2023	200	214,538	0.2
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	355	377,587	0.4
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	210	211,614	0.2
				<u>803,739</u>	<u>0.8</u>
OMAN					
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	449	469,289	0.5
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	222	234,765	0.2
				<u>704,054</u>	<u>0.7</u>
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	400	407,075	0.4
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029	257	271,906	0.3
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	324	325,984	0.3
				<u>597,890</u>	<u>0.6</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	545	578,313	0.5
				<u>7,822,482</u>	<u>7.4</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB FCPI I - Mortgage Income Portfolio - Class SA			9,458	760,421	0.7
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			30,616	3,260,571	3.1
				<u>4,020,992</u>	<u>3.8</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(h)	1.00%	11/15/2050	USD 1,963	87,750	0.1
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(h)	1.00%	02/10/2050	973	44,171	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(h)	1.59%	06/15/2050	803	53,258	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2016-C3, Class XA(h)	1.13%	11/15/2049	USD 1,934	\$ 78,751	0.1%
Series 2016-P3, Class XA(h)	1.70%	04/15/2049	3,304	199,930	0.2
Series 2018-C6, Class XA(h)	0.78%	11/10/2051	1,977	100,905	0.1
Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-CR27, Class XA(h)	0.91%	10/10/2048	335	11,637	0.0
Series 2016-COR1, Class XA(h)	1.39%	10/10/2049	2,529	135,633	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(h)	0.96%	02/10/2049	5,814	214,540	0.2
Series 2017-COR2, Class XA(h)	1.16%	09/10/2050	3,698	226,865	0.2
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	90	54,865	0.1
Series 2016-GS3, Class XA(h)	1.22%	10/10/2049	4,804	253,564	0.2
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-C5, Class XA(h)					
	0.94%	03/15/2050	1,671	72,875	0.1
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2016-JP2, Class XA(h)					
	1.79%	08/15/2049	925	68,455	0.1
LB-UBS Commercial Mortgage Trust, Series 2006-C6, Class AJ ...					
	5.45%	09/15/2039	214	114,722	0.1
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust, Series 2015-C22, Class XA(h)					
	1.03%	04/15/2048	1,371	40,805	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C1, Class D	5.57%	05/10/2045	60	52,772	0.1
Series 2018-C10, Class XA(h)	0.94%	05/15/2051	978	51,118	0.0
Series 2018-C14, Class XA(h)	0.99%	12/15/2051	1,961	118,432	0.1
Series 2018-C15, Class XA(h)	0.92%	12/15/2051	1,842	103,324	0.1
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-LC20, Class XA(h)	1.31%	04/15/2050	852	29,261	0.0
Series 2016-C32, Class XA(h)	1.21%	01/15/2059	1,367	65,162	0.1
Series 2016-C33, Class XA(h)	1.61%	03/15/2059	3,398	215,896	0.2
Series 2016-C36, Class XA(h)	1.26%	11/15/2059	2,506	132,129	0.1
Series 2016-LC24, Class XA(h)	1.65%	10/15/2049	1,255	84,397	0.1
Series 2016-LC25, Class XA(h)	0.96%	12/15/2059	1,019	35,766	0.0
Series 2018-C48, Class XA(h)	0.94%	01/15/2052	3,373	200,048	0.2
WFRBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	5.13%	06/15/2044	25	15,487	0.0
Series 2014-LC14, Class C	4.34%	03/15/2047	11	11,311	0.0
				<u>2,873,829</u>	<u>2.7</u>
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class D(d)	4.10%	05/15/2036	64	44,824	0.1
				<u>2,918,653</u>	<u>2.8</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABLE VERZINSLICH					
AGL CLO Ltd., Series 2020-9A, Class D(d)	3.89%	01/20/2034	250	251,979	0.3
AGL CLO Ltd., Series 2021-10A, Class D(d)	3.09%	04/15/2034	250	250,167	0.2
AGL CLO Ltd., Series 2021-11A, Class D(d)	0.00%	04/15/2034	250	250,000	0.2
Apidos CLO, Series 2021-35A, Class D(d)	2.85%	04/20/2034	250	250,079	0.2
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class C(d)	3.80%	01/20/2034	250	251,035	0.3
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(d)	1.93%	04/26/2031	300	294,340	0.3
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(d)	6.49%	07/18/2030	250	249,799	0.2
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A2(d)	1.81%	04/26/2031	300	300,067	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class D(d)					
	3.79%	01/20/2032	250	251,214	0.3
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(d)					
	5.39%	01/20/2031	250	238,036	0.2
				<u>2,586,716</u>	<u>2.5</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025	150	151,116	0.1
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	200	214,975	0.2
Eldorado Gold Corp.	9.50%	06/01/2024	145	158,045	0.2
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	200	212,475	0.2
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	200	220,543	0.2
Volcan Cia Minera SAA.	4.38%	02/11/2026	17	16,594	0.0
				<u>973,748</u>	<u>0.9</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	90	95,654	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	200	227,584	0.2
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	141	1,412	0.0
				<u>324,650</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Digicel International Finance Ltd./					
Digicel international Holdings Ltd.....	8.75%	05/25/2024	USD 97	\$ 100,347	0.1%
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Wynn Macau Ltd.....	5.50%	01/15/2026	212	222,181	0.2
ENERGIE					
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	323	348,276	0.3
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	86	95,766	0.1
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030	200	157,163	0.2
Petrobras Global Finance BV	6.90%	03/19/2049	255	296,531	0.3
				897,736	0.9
				2,518,662	2.4
FINANZINSTITUTE					
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(a)	4.38%	10/25/2029	118	14,808	0.0
				2,533,470	2.4
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN					
KANADA					
Province of Alberta Canada	3.40%	12/01/2023	CAD 687	608,269	0.6
Province of British Columbia Canada, Series T	9.00%	08/23/2024	514	537,410	0.5
Province of Manitoba Canada	7.75%	12/22/2025	444	474,756	0.5
Province of Saskatchewan Canada	3.20%	06/03/2024	761	676,106	0.6
				2,296,541	2.2
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
BAHRAIN					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	7.50%	10/25/2027	USD 200	224,475	0.2
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	8.38%	11/07/2028	200	233,725	0.3
				458,200	0.5
CHILE					
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031	213	228,176	0.2
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA.....	3.65%	05/07/2030	200	213,938	0.2
				442,114	0.4
MEXIKO					
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	235	228,537	0.2
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	69	73,668	0.1
Petroleos Mexicanos	6.50%	01/23/2029	24	24,534	0.0
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	195	172,322	0.1
Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030	190	196,439	0.2
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	80	70,280	0.1
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	113	108,819	0.1
				874,599	0.8
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.....	6.00%	11/18/2048	197	212,042	0.2
				1,986,955	1.9
BEHÖRDEN					
SCHULDVERSCHREIBUNGEN VON BEHÖRDEN					
Federal Home Loan Banks.	5.50%	07/15/2036	135	195,500	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp.....	6.25%	07/15/2032	222	323,254	0.3
Federal Home Loan Mortgage Corp.....	6.75%	03/15/2031	200	292,653	0.3
Federal National Mortgage Association.....	6.25%	05/15/2029	141	192,102	0.2
Federal National Mortgage Association.....	6.63%	11/15/2030	400	575,836	0.5
				1,579,345	1.5
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE					
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	16.95%	02/04/2022	DOP 3,700	69,987	0.1
ÄGYPTEN					
Egypt Government Bond, Series 5YR.....	14.06%	01/12/2026	EGP 2,175	133,592	0.1
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government Bond, Series 2032	8.25%	03/31/2032	ZAR 2,025	133,022	0.1
Republic of South Africa Government Bond, Series R186	10.50%	12/21/2026	13,635	1,129,712	1.1
				1,262,734	1.2
				1,466,313	1.4

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG							
BRASILIEN							
	Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2023	BRL	6,019	\$ 1,207,467	1.1%
ABS-ANLEIHEN							
AUTOS – FESTVERZINSLICH							
	Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2018-1A, Class C	4.73%	09/20/2024	USD	128	136,484	0.1
	Exeter Automobile Receivables Trust, Series 2017-3A, Class D	5.28%	10/15/2024		350	362,195	0.4
	First Investors Auto Owner Trust, Series 2017-1A, Class E	5.86%	11/15/2023		190	191,830	0.2
	Flagship Credit Auto Trust, Series 2018-3, Class D	4.15%	12/16/2024		30	31,421	0.0
						721,930	0.7
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS							
	Marlette Funding Trust Series 2018-3A, Class C	4.63%	09/15/2028		189	191,194	0.2
	Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028		28	28,450	0.0
	SoFi Consumer Loan Program Trust, Series 2018-2, Class C	4.25%	04/26/2027		100	103,425	0.1
						323,069	0.3
						1,044,999	1.0
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN							
KOLUMBIEN							
	Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032		216	207,900	0.2
ISRAEL							
	Israel Government International Bond	2.75%	07/03/2030		207	218,888	0.2
MEXIKO							
	Mexico Government International Bond	3.90%	04/27/2025		213	237,335	0.2
PANAMA							
	Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026		110	118,835	0.1
						782,958	0.7
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG							
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE							
	Egypt Government International Bond	5.75%	05/29/2024		218	232,483	0.2
STAMMAKTIE							
KOMMUNIKATIONS-DIENSTLEISTUNGEN							
MEDIEN							
	iHeartMedia, Inc. - Class A				587	13,624	0.0
ENERGIE							
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE							
	Bonanza Creek Energy, Inc.				149	6,401	0.0
	Denbury, Inc.				595	39,877	0.1
	Gulfport Energy Corp.				1,242	77,625	0.1
	Whiting Petroleum Corp.				595	27,245	0.0
						151,148	0.2
						164,772	0.2
						99,314,767	94.3
GELDMARKTINSTRUMENTE							
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE							
ÄGYPTEN							
	Egypt Treasury Bills, Series 364D	0.00%	06/29/2021	EGP	3,875	244,897	0.2
						99,559,664	94.5
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE							
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN							
CLO – VARIABLE VERZINSLICH							
	CBAM Ltd., Series 2018-7A, Class B1(d)	1.79%	07/20/2031	USD	278	278,007	0.3
	Dryden CLO Ltd., Series 2018-57A, Class A(d)	1.17%	05/15/2031		250	250,177	0.3
	GoldenTree Loan Opportunities IX Ltd., Series 2014-9A, Class DR2(d)	3.18%	10/29/2029		250	248,590	0.2
	Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A1(d)	1.21%	04/26/2031		250	249,416	0.2
	Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A2(d)	1.99%	07/21/2031		250	250,000	0.2
	Northwoods Capital Ltd., Series 2018-12BA, Class B(d)	2.03%	06/15/2031		250	244,541	0.2
	OZLM Ltd., Series 2018-18A, Class B(d)	1.73%	04/15/2031		300	299,199	0.3
	Rockford Tower CLO Ltd., Series 2017-2A, Class DR(d)	3.03%	10/15/2029		250	249,996	0.2
	Sound Point CLO XIX Ltd., Series 2018-1A, Class A(d)	1.18%	04/15/2031		500	500,239	0.5
						2,570,165	2.4

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
SONSTIGE FINANZWERTE					
Nordic Aviation Capital(i)	5.04%	02/27/2024	USD 511	\$ 352,685	0.3%
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Kleopatra Finco SARL.	4.25%	03/01/2026	EUR 100	122,007	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide Technologies, (Exchange Priority)(i).	11.00%	10/31/2024	USD 44	0	0.0
Exide Technologies, (First Lien)(i)	11.00%	10/31/2024	18	0	0.0
				0	0.0
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp.(i)	6.00%	10/15/2024	30	0	0.0
Gulfport Energy Corp.(i)	6.38%	05/15/2025	45	0	0.0
Gulfport Energy Corp.(i)	6.38%	01/15/2026	35	0	0.0
Gulfport Energy Corp.(i)	6.63%	05/01/2023	3	0	0.0
				0	0.0
DIENSTLEISTUNGEN					
Monitronics International, Inc.(i) (j)	9.13%	04/01/2020	62	0	0.0
				122,007	0.1
				474,692	0.4
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Natwest Group PLC(c)	8.63%	08/15/2021	200	202,777	0.2
INDUSTRIE					
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.50%	10/20/2025	42	45,579	0.0
				248,356	0.2
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Digicel Group Holdings Ltd.(a)	10.00%	04/01/2024	186	182,287	0.2
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	9	9,273	0.0
				191,560	0.2
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABLE VERZINSLICH					
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(d).	2.44%	02/27/2023	140	140,359	0.1
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-20, Class PT.	11.04%	11/16/2043	40	40,382	0.0
Series 2019-36, Class PT.	13.01%	10/17/2044	46	46,685	0.1
Series 2019-43, Class PT.	6.03%	11/15/2044	24	23,984	0.0
				111,051	0.1
VORZUGSAKTIE					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide International Holdings LP(i)	0.00%		136	109,140	0.1
ENERGIE					
Gulfport Energy Operating Corp.(i).	0.00%		3	13,368	0.0
				122,508	0.1
STAMMAKTIE					
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
ATD New Holdings, Inc. (i)			660	31,680	0.1
Exide Corp. (i)			10	22,500	0.0
				54,180	0.1
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Diamond Offshore Drilling, Inc. (i)			869	4,483	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
SOFTWARE					
Monitronics International, Inc.			2,309	\$ 19,742	0.0%
				78,405	0.1
				3,937,096	3.6
Gesamtanlagen				\$ 103,496,760	98.1%
(Kosten \$101,428,224)					
Termineinlagen					
Barclays, London(k)	0.01 %	—		3,949,548	3.8
HSBC Bank PLC, Paris(k)	(0.78)%	—		12,195	0.0
Termineinlagen insgesamt				3,961,743	3.8
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(1,994,169)	(1.9)
Nettovermögen				\$ 105,464,334	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
10 Yr Australian Bond Futures	06/15/2021	24	\$ 2,566,542	\$ 2,593,439	\$ 26,897
U.S. Long Bond (CBT) Futures	09/21/2021	6	942,141	939,188	(2,953)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	142	17,556,773	17,586,922	30,149
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	237	31,221,047	31,269,188	48,141
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2021	11	2,043,805	2,037,750	(6,055)
Short					
Canadian 10 Yr Bond Futures	09/21/2021	5	595,273	597,037	(1,764)
Euro Buxl 30 Yr Bond Futures	06/08/2021	3	758,742	735,255	23,487
Euro-BOBL Futures	06/08/2021	9	1,481,741	1,478,778	2,963
Long Gilt Futures	09/28/2021	2	360,691	361,174	(483)
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2021	19	2,747,875	2,754,109	(6,234)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	28	6,177,609	6,180,563	(2,954)
					\$ 111,194
				Wertsteigerung	\$ 131,637
				Wertminderung	\$ (20,443)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	ZAR 19,954	USD 1,361	06/17/2021	\$ (84,343)
Bank of America, NA.	RUB 59,233	USD 797	07/28/2021	(4,804)
Barclays Bank PLC	AUD 1,110	USD 845	06/04/2021	(10,673)
Barclays Bank PLC	CNH 8,958	USD 1,374	06/24/2021	(32,948)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 757	AUD 980	06/04/2021	(1,531)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 102	GBP 74	06/17/2021	3,123
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 137	ZAR 1,911	06/17/2021	1,584
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,423	AUD 3,131	06/21/2021	(8,526)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 713	PLN 2,639	06/21/2021	5,265
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,347	SGD 3,128	06/21/2021	18,819
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 949	CAD 1,150	06/30/2021	2,710
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 23	CHF 21	06/30/2021	(70)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 163	EUR 133	06/30/2021	(348)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 12	GBP 9	06/30/2021	(10)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 190	GBP 134	06/30/2021	605
Citibank, NA	COP 2,874,196	USD 765	07/15/2021	(8,063)
Citibank, NA	PEN 5,000	USD 1,368	07/15/2021	52,910
Citibank, NA	CAD 12,978	USD 10,368	07/16/2021	(374,667)
Deutsche Bank AG	AUD 2,624	USD 2,047	06/04/2021	23,932
Deutsche Bank AG	INR 9,468	USD 127	07/15/2021	(2,558)
Goldman Sachs Bank USA	USD 1,230	BRL 6,531	06/02/2021	23,663
Goldman Sachs Bank USA	BRL 6,531	USD 1,226	07/02/2021	(23,435)
Morgan Stanley Capital Services LLC	MXN 28,434	USD 1,407	06/18/2021	(18,228)
Royal Bank of Scotland PLC	BRL 6,531	USD 1,205	06/02/2021	(47,795)
Standard Chartered Bank	KRW 162,130	USD 145	07/22/2021	(131)
UBS AG	EUR 6,812	USD 8,353	08/03/2021	35,688
				\$ (449,831)
			Wertsteigerung	\$ 168,299
			Wertminderung	\$ (618,130)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen 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	06/20/2026	USD	1,120	\$	(45,801)	\$	(2,378)
Verkaufskontrakte								
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025		71		6,836		4,004
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025		478		46,449		22,996
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	06/20/2026		758		73,301		4,344
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Federative Republic of Brazil	06/20/2026		346		(11,886)		5,164
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 35, 5 Year Index	06/20/2026	EUR	1,070		154,247		17,729
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Republic of South Africa	06/20/2026	USD	324		(14,094)		5,505
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Russian Federation	06/20/2026		313		523		2,343
Insgesamt						<u>\$ 209,575</u>		<u>\$ 59,707</u>
						Wertsteigerung	\$	62,085
						Wertminderung	\$	(2,378)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 5,940	04/20/2023	2.850%	3 Month LIBOR	\$ (296,045)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	1,550	10/30/2027	2.443%	3 Month LIBOR	(126,333)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	640	07/11/2027	2.372%	3 Month LIBOR	(49,083)
Insgesamt					\$ (471,461)

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.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 450	\$ 126,585	\$ 56,501	\$ 70,084
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	750	210,975	72,509	138,466
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25	(7,033)	(6,573)	(460)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	31	(8,720)	(3,416)	(5,304)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	45	(12,659)	(10,842)	(1,817)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	46	(12,940)	(11,195)	(1,745)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	61	(17,159)	(14,697)	(2,462)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	71	(19,972)	(7,036)	(12,936)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	344	(96,767)	(49,535)	(47,232)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	443	(124,616)	(43,675)	(80,941)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	443	(124,616)	(43,209)	(81,407)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	443	(124,616)	(43,209)	(81,407)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	475	(133,618)	(49,761)	(83,857)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	29	(2,561)	(1,119)	(1,442)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	59	(5,210)	(2,321)	(2,889)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	70	(6,181)	(2,882)	(3,299)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	147	(12,980)	(5,674)	(7,306)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	36	(10,127)	(3,972)	(6,155)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	300	(26,490)	(11,835)	(14,655)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	647	(182,001)	(89,666)	(92,335)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,009	(283,832)	(155,615)	(128,217)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	300	(84,390)	(28,180)	(56,210)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	400	(112,520)	(49,318)	(63,202)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	591	(166,248)	(66,859)	(99,389)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	709	(199,442)	(80,362)	(119,080)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	200	(56,260)	(28,673)	(27,587)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	300	(84,390)	(43,024)	(41,366)

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nomineller Betrag (000)	Markt- wert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 400	\$ (112,520)	\$ (50,649)	\$ (61,871)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A- Series 6	05/11/2063	4	(320)	(145)	(175)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	700	(196,910)	(104,087)	(92,823)
Insgesamt				<u>\$ (1,887,538)</u>	<u>\$ (878,519)</u>	<u>\$ (1,009,019)</u>
					Wertsteigerung	\$ 208,550
					Wertminderung	\$ (1,217,569)

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	3,200,000	3 Month LIBOR	USD 3,200	06/20/2021	\$ (69,991)
Swaps insgesamt					<u>\$ (1,490,764)</u>

UMGEKEHRTE PENSIONS-GESCHÄFTE

Makler	Kapitalbetrag (000)	Währung	Zinssatz	Fälligkeit	USD-Wert
JPMorgan Chase Bank, NA†	1,193	USD	0.08%	—	\$ 1,192,500
JPMorgan Chase Bank, NA†	1,010	USD	0.14%	—	1,009,688
JPMorgan Chase Bank, NA†	941	USD	0.14%	—	940,625
					<u>\$ 3,142,813</u>

† Das umgekehrte Pensionsgeschäft wird auf Verlangen fällig. Der Zinssatz wird täglich neu festgesetzt. Der angegebene Zinssatz ist der am 31. Mai 2021 gültige Zinssatz.

- (a) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (b) Not leidend.
- (c) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (d) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2021.
- (e) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für Derivate zu dienen.
- (f) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für umgekehrte Pensionsgeschäfte zu dienen.
- (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) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.
- (j) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (k) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
 BRL – Brazilian Real
 CAD – Canadian Dollar
 CHF – Swiss Franc
 CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
 CNY – Chinese Yuan Renminbi
 COP – Colombian Peso
 EGP – Egyptian Pound
 EUR – Euro
 GBP – Great British Pound
 INR – Indian Rupee
 KRW – South Korean Won
 MXN – Mexican Peso
 PEN – Peruvian Sol
 PLN – Polish Zloty

RUB – Russian Ruble
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
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 GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Cohrent, Inc.	3,808	\$ 1,000,019	1.7%
Keyence Corp.	380	187,840	0.3
Murata Manufacturing Co., Ltd.	3,000	227,242	0.4
		<u>1,415,101</u>	<u>2.4</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Amadeus IT Group SA - Class A	1,734	130,841	0.2
Automatic Data Processing, Inc.	2,274	445,749	0.7
Capgemini SE	2,591	484,439	0.8
Cardtronics PLC - Class A	8,509	331,255	0.5
Fidelity National Information Services, Inc.	671	99,966	0.2
Genpact Ltd.	1,300	59,462	0.1
Mastercard, Inc. - Class A	1,249	450,364	0.8
Nomura Research Institute Ltd.	1,400	44,605	0.1
Paychex, Inc.	2,068	209,158	0.3
Visa, Inc. - Class A	495	112,514	0.2
		<u>2,368,353</u>	<u>3.9</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV	478	322,932	0.5
Broadcom, Inc.	113	53,373	0.1
Dialog Semiconductor PLC	11,874	941,429	1.6
KLA Corp.	172	54,505	0.1
MagnaChip Semiconductor Corp.	12,405	293,999	0.5
Maxim Integrated Products, Inc.	10,755	1,097,118	1.8
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. (Sponsored ADR)	1,095	128,509	0.2
Texas Instruments, Inc.	749	142,175	0.2
Xilinx, Inc.	6,790	862,330	1.4
		<u>3,896,370</u>	<u>6.4</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	90	45,412	0.1
Citrix Systems, Inc.	1,157	133,009	0.2
Constellation Software, Inc./Canada	95	136,351	0.2
Microsoft Corp.	3,244	809,962	1.3
NortonLifeLock, Inc.	2,000	55,320	0.1
Nuance Communications, Inc.	17,748	938,869	1.5
Oracle Corp.	2,785	219,291	0.4
Oracle Corp. Japan	500	45,218	0.1
SAP SE	1,262	176,697	0.3
Slack Technologies, Inc. - Class A	20,806	916,296	1.5
Talend SA (ADR)	6,383	414,704	0.7
		<u>3,891,129</u>	<u>6.4</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	1,892	235,762	0.4
Logitech International SA	509	62,596	0.1
		<u>298,358</u>	<u>0.5</u>
		<u>11,869,311</u>	<u>19.6</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	13,236	106,217	0.2
Bank of America Corp.	1,073	45,484	0.1
CIT Group, Inc.	19,123	1,013,136	1.7
Compute Health Acquisition Corp.	13,650	133,087	0.2
DBS Group Holdings Ltd.	3,900	89,609	0.1
JPMorgan Chase & Co.	715	117,432	0.2
KBC Group NV	684	55,995	0.1
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	10,500	60,303	0.1
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	5,100	48,177	0.1
People's United Financial, Inc.	41,465	784,103	1.3
Royal Bank of Canada	1,710	177,816	0.3
TCF Financial Corp.	20,956	995,410	1.6
Toronto-Dominion Bank (The)	1,311	94,490	0.2
US Bancorp	1,379	83,816	0.1
		<u>3,805,075</u>	<u>6.3</u>
KAPITALMÄRKTE			
Charles Schwab Corp. (The)	5,715	422,053	0.7
CME Group, Inc. - Class A	784	171,508	0.3
Partners Group Holding AG	96	144,898	0.2

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
S&P Global, Inc.	312	\$ 118,394	0.2%
Singapore Exchange Ltd.	6,800	53,377	0.1
T. Rowe Price Group, Inc.	475	90,891	0.1
		<u>1,001,121</u>	<u>1.6</u>
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd.	12,200	162,825	0.2
Allianz SE (REG)	203	53,909	0.1
Athene Holding Ltd. - Class A	12,517	783,940	1.3
Progressive Corp. (The)	445	44,091	0.1
Sampo Oyj - Class A	1,267	60,345	0.1
Zurich Insurance Group AG	120	50,472	0.1
		<u>1,155,582</u>	<u>1.9</u>
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG			
Flagstar Bancorp, Inc.	21,351	977,876	1.6
Meridian Bancorp, Inc.	6,705	147,845	0.3
		<u>1,125,721</u>	<u>1.9</u>
		<u>7,087,499</u>	<u>11.7</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Genmab A/S	681	278,169	0.5
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	2,128	248,231	0.4
Cantel Medical Corp.	11,289	918,134	1.5
Koninklijke Philips NV	2,954	166,920	0.3
Medtronic PLC	455	57,599	0.1
		<u>1,390,884</u>	<u>2.3</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Anthem, Inc.	377	150,129	0.2
UnitedHealth Group, Inc.	574	236,442	0.4
		<u>386,571</u>	<u>0.6</u>
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Change Healthcare, Inc.	42,724	1,001,451	1.6
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Eurofins Scientific SE	1,802	193,059	0.3
IQVIA Holdings, Inc.	1,259	302,361	0.5
Luminex Corp.	17,635	650,555	1.0
PPD, Inc.	18,311	844,503	1.4
PRA Health Sciences, Inc.	5,991	1,023,982	1.7
Thermo Fisher Scientific, Inc.	105	49,298	0.1
		<u>3,063,758</u>	<u>5.0</u>
PHARMAZEUTIKA			
Eli Lilly & Co.	290	57,924	0.1
Johnson & Johnson	343	58,053	0.1
Merck & Co., Inc.	1,367	103,742	0.2
Novo Nordisk A/S - Class B	1,647	130,024	0.2
Roche Holding AG	783	274,090	0.5
Zoetis, Inc.	1,473	260,250	0.4
		<u>884,083</u>	<u>1.5</u>
		<u>7,004,916</u>	<u>11.5</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	2,248	338,144	0.5
Cooper Tire & Rubber Co.	15,952	947,230	1.6
		<u>1,285,374</u>	<u>2.1</u>
VERTRIEBSSTELLEN			
Core-Mark Holding Co., Inc.	474	21,737	0.0
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	4,459	144,253	0.2
Compass Group PLC	5,345	121,842	0.2
McDonald's Corp.	212	49,585	0.1
		<u>315,680</u>	<u>0.5</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Garmin Ltd.	609	86,624	0.2
Sony Group Corp.	1,200	119,324	0.2
		<u>205,948</u>	<u>0.4</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd. (Sponsored ADR)	1,001	\$ 214,174	0.4%
Amazon.com, Inc.	125	402,884	0.6
Grubhub, Inc.	15,219	914,814	1.5
		<u>1,531,872</u>	<u>2.5</u>
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Dollar General Corp.	219	44,448	0.1
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	145	203,957	0.3
GrandVision NV	22,620	753,042	1.3
Home Depot, Inc. (The)	678	216,221	0.4
O'Reilly Automotive, Inc.	111	59,398	0.1
Ross Stores, Inc.	675	85,313	0.1
Sportsman's Warehouse Holdings, Inc.	35,676	635,033	1.1
TJX Cos., Inc. (The)	3,924	265,027	0.4
		<u>2,217,991</u>	<u>3.7</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Deckers Outdoor Corp.	416	139,543	0.2
NIKE, Inc. - Class B	1,245	169,893	0.3
		<u>309,436</u>	<u>0.5</u>
		<u>5,932,486</u>	<u>9.8</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
L3Harris Technologies, Inc.	348	75,885	0.1
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Knoll, Inc.	14,572	378,872	0.6
Seaport Global Acqui-class A	1,587	15,775	0.0
Stericycle, Inc.	2,091	164,269	0.3
		<u>558,916</u>	<u>0.9</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Generac Holdings, Inc.	172	56,540	0.1
Nidec Corp.	2,300	263,736	0.4
Regal Beloit Corp.	525	74,671	0.1
Schneider Electric SE (Paris)	548	87,219	0.2
		<u>482,166</u>	<u>0.8</u>
MASCHINEN			
Alstom SA	4,780	269,729	0.5
Navistar International Corp.	2,443	108,054	0.2
Welbilt, Inc.	37,903	936,583	1.5
		<u>1,314,366</u>	<u>2.2</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	1,212	102,935	0.2
CoreLogic Inc/United States	3,274	260,283	0.4
Recruit Holdings Co., Ltd.	5,300	271,657	0.5
RELX PLC	5,618	147,207	0.2
Verisk Analytics, Inc. - Class A	1,273	220,012	0.4
Wolters Kluwer NV	1,165	111,883	0.2
		<u>1,113,977</u>	<u>1.9</u>
STRASSE UND SCHIENE			
Kansas City Southern	3,104	923,999	1.5
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Ashtead Group PLC	4,111	299,888	0.5
		<u>4,769,197</u>	<u>7.9</u>
DIVERSIFIZIERT			
ERWERBSGESELLSCHAFT FÜR BESONDERE ZWECKE			
Austerlitz Acquisition Corp. I	14,469	142,954	0.2
CC Neuberger Principal Holdings III	15,610	156,100	0.3
Churchill Capital Corp. VII	3,533	34,553	0.1
Constellation Acquisition Corp. I	6,801	66,514	0.1
Crucible Acquisition Corp.	12,431	120,829	0.2
DiamondHead Holdings Corp.	7,755	75,068	0.1
Fortress Capital Acquisition Corp.	13,725	133,819	0.2
Global Partner Acquisition Corp. II	13,725	134,368	0.2
Global Synergy Acquisition Corp.	15,145	147,058	0.3
Gores Metropoulos II, Inc.	5,490	54,131	0.1
Group Nine Acquisition Corp.	6,862	66,905	0.1
Hudson Executive Investment Corp. II	14,485	142,532	0.2
New Vista Acquisition Corp.	14,060	135,960	0.2
North Atlantic Acquisition Cor	14,483	140,340	0.2
Northern Genesis Acquisition Corp. II	13,725	134,505	0.2

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Pioneer Merger Corp.	13,725	\$ 135,603	0.2%
Pontem Corp.	13,725	132,995	0.2
Powered Brands	14,840	145,729	0.3
RMG Acquisition Corp. III	2,264	22,142	0.1
Rotor Acquisition Corp.	13,725	135,878	0.2
Seven Oaks Acquisition Corp.	13,725	134,093	0.2
Star Peak Corp. II	11,664	115,124	0.2
Thunder Bridge Capital Partners III, Inc.	3,773	36,636	0.1
TLG Acquisition One Corp.	14,503	140,244	0.2
VectoIQ Acquisition Corp. II	6,862	66,870	0.1
		<u>2,750,950</u>	<u>4.5</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Comcast Corp. - Class A	1,779	102,008	0.1
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	6,100	165,190	0.3
ORBCOMM, Inc.	11,053	123,683	0.2
Shaw Communications, Inc. - Class B	1,331	39,795	0.1
		<u>430,676</u>	<u>0.7</u>
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	1,235	120,104	0.2
Electronic Arts, Inc.	544	77,754	0.1
Ubisoft Entertainment SA	565	41,096	0.1
Walt Disney Co. (The)	1,395	249,216	0.4
		<u>488,170</u>	<u>0.8</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	125	301,445	0.5
Auto Trader Group PLC	13,987	111,300	0.2
Facebook, Inc. - Class A	1,360	447,073	0.7
Kakaku.com, Inc.	2,300	68,455	0.1
Tencent Holdings Ltd.	3,000	234,543	0.4
		<u>1,162,816</u>	<u>1.9</u>
		<u>2,081,662</u>	<u>3.4</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Akzo Nobel NV	683	87,202	0.2
Ferro Corp.	5,754	124,286	0.2
International Flavors & Fragrances, Inc.	1,348	190,971	0.3
Johnson Matthey PLC	1,770	76,354	0.1
W R Grace & Co.	3,628	248,590	0.4
		<u>727,403</u>	<u>1.2</u>
BAUMATERIAL			
Forterra, Inc.	24,603	575,218	1.0
PAPIER- UND HOLZPRODUKTE			
Domtar Corp.	13,798	748,266	1.2
		<u>2,050,887</u>	<u>3.4</u>
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
American Campus Communities, Inc.	824	38,860	0.1
American Tower Corp.	693	177,034	0.3
Nippon Building Fund, Inc.	9	57,544	0.1
VEREIT, Inc.	21,990	1,046,064	1.7
Weingarten Realty Investors	887	29,067	0.0
		<u>1,348,569</u>	<u>2.2</u>
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG			
Deutsche Wohnen SE	5,192	330,566	0.6
Vonovia SE	861	54,044	0.1
		<u>384,610</u>	<u>0.7</u>
		<u>1,733,179</u>	<u>2.9</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	1,558	86,142	0.2
Treasury Wine Estates Ltd.	20,464	185,477	0.3
		<u>271,619</u>	<u>0.5</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	5,445	158,517	0.3
Walmart, Inc.	1,243	176,543	0.3
		<u>335,060</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Morinaga & Co., Ltd./Japan			1,600	\$ 49,707	0.1%
Nestle SA			2,622	323,865	0.5
Salmar ASA			2,654	195,939	0.3
				<u>569,511</u>	<u>0.9</u>
HAUSHALTSPRODUKTE					
Procter & Gamble Co. (The)			1,093	147,391	0.2
				<u>1,323,581</u>	<u>2.2</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
Enel SpA			14,129	140,122	0.2
NextEra Energy, Inc.			1,510	110,562	0.2
PNM Resources, Inc.			1,237	60,761	0.1
				<u>311,445</u>	<u>0.5</u>
MEHRFACH-VERSORGUNGSBETRIEBE					
Ameren Corp.			1,028	86,558	0.1
Dominion Energy, Inc.			736	56,039	0.1
				<u>142,597</u>	<u>0.2</u>
				<u>454,042</u>	<u>0.7</u>
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Royal Dutch Shell PLC - Class B			7,173	130,414	0.2
				<u>47,188,124</u>	<u>77.8</u>
OPTIONSSCHEINE					
DIVERSIFIZIERT					
ERWERBSGESELLSCHAFT FÜR BESONDERE ZWECKE					
Austerlitz Acquisition Corp. I, - Class A, expiring 02/19/2026			3,617	5,462	0.0
CC Neuberger Principal Holdings III, expiring 02/05/2026			3,122	3,497	0.0
Churchill Capital Corp. VII, expiring 02/17/2026			706	812	0.0
Constellation Acquisition Corp. I, expiring 01/29/2028			2,267	1,675	0.0
Crucible Acquisition Corp., expiring 01/07/2025			4,143	4,184	0.0
DiamondHead Holdings Corp., expiring 01/28/2028			1,938	2,132	0.0
Fortress Capital Acquisition Corp., expiring 01/15/2026			2,745	2,690	0.0
Global Partner Acquisition Corp. II, expiring 01/11/2028			2,287	2,053	0.0
Global Synergy Acquisition Corp., - Class A, expiring 01/12/2025			7,572	4,553	0.0
Gores Metropoulos II, Inc., expiring 01/31/2028			1,098	1,274	0.0
Group Nine Acquisition Corp., expiring 01/20/2028			2,287	1,629	0.0
Hudson Executive Investment Corp. II, expiring 01/28/2026			3,621	3,223	0.0
New Vista Acquisition Corp., expiring 02/19/2026			4,686	3,889	0.0
North Atlantic Acquisition Corp., expiring 10/20/2025			4,827	4,231	0.0
Northern Genesis Acquisition Corp. II, expiring 01/15/2026			4,575	6,062	0.0
Northern Star Investment Corp. II, expiring 01/31/2028			1,931	3,534	0.0
Pioneer Merger Corp., expiring 01/12/2026			4,575	6,862	0.1
Pontem Corp., expiring 01/15/2028			4,575	3,660	0.0
Powered Brands, expiring 01/09/2026			4,946	3,512	0.0
RMG Acquisition Corp. III, - Class A, expiring 02/09/2026			452	393	0.0
Rotor Acquisition Corp., expiring 06/15/2027			6,862	6,862	0.0
Seven Oaks Acquisition Corp., - Class A, expiring 12/22/2025			6,862	5,600	0.0
Star Peak Corp. II, expiring 01/08/2025			2,916	3,937	0.0
Thunder Bridge Capital Partners III, Inc., - Class A, expiring 02/15/2028			754	701	0.0
TLG Acquisition One Corp., expiring 02/01/2028			4,834	3,045	0.0
VectoIQ Acquisition Corp. II, expiring 01/11/2028			1,372	1,427	0.0
				<u>86,899</u>	<u>0.1</u>
FINANZWERTE					
BANKEN					
Compute Health Acquisition Corp. - Class A			3,412	4,061	0.0
				<u>90,960</u>	<u>0.1</u>
				<u>47,279,084</u>	<u>77.9</u>
GELDMARKTINSTRUMENTE					
US-SCHATZWECHSEL					
U.S. Treasury Bill(a)	0.00%	07/15/2021	USD 1,781,400	1,781,379	3.0
U.S. Treasury Bill	0.00%	06/08/2021	987,200	987,199	1.6
U.S. Treasury Bill	0.00%	06/17/2021	866,100	866,098	1.4
U.S. Treasury Bill(a)	0.00%	06/10/2021	746,800	746,799	1.2
U.S. Treasury Bill	0.00%	09/02/2021	594,800	594,769	1.0
U.S. Treasury Bill	0.00%	06/15/2021	536,300	536,299	0.9
				<u>5,512,543</u>	<u>9.1</u>
				<u>52,791,627</u>	<u>87.0</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
VERBRAUCHSGÜTER					
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Progenic Pharmaceuticals Cvr (b)			57,701	\$ 0	0.0%
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
SOFTWARE					
Proofpoint, Inc.			2,889	499,248	0.8
Gesamtanlagen				\$ 53,290,875	87.8%
(Kosten \$48,687,949)					
Termineinlagen					
ANZ, London(c)	(0.13)%	—		2,892	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(c)	0.01 %	—		54,600	0.1
BNP Paribas, Paris(c)	(0.53)%	—		1,882	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.00 %	—		2,049	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.01 %	—		1,007	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(c)	(1.44)%	—		143,115	0.2
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(c)	0.00 %	—		1,511	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(c)	(0.78)%	—		492,971	0.8
Nordea Bank Abp, Oslo(c)	(0.13)%	—		1,193	0.0
SEB, Stockholm(c)	(0.28)%	—		6,249	0.0
Sumitomo, London(c)	0.01 %	—		1,736,869	2.9
Sumitomo, Tokyo(c)	(0.29)%	—		166,365	0.3
Termineinlagen insgesamt				2,610,703	4.3
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				4,785,507	7.9
Nettovermögen				\$ 60,687,085	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Australian 10 Yr Bond Futures	06/15/2021	23	\$ 2,460,466	\$ 2,485,379	\$ 24,913
BIST 30 Futures	06/30/2021	503	903,428	898,584	(4,844)
Canadian 10 Yr Bond Futures	09/21/2021	8	952,427	955,258	2,831
FTSE 100 Index Futures	06/18/2021	8	781,927	796,439	14,512
FTSE KLCI Futures	06/30/2021	107	2,040,519	2,059,883	19,364
Hang Seng Index Futures	06/29/2021	7	1,295,970	1,308,496	12,526
MSCI Singapore IX ETS Futures	06/29/2021	24	649,267	655,485	6,218
SPI 200 Index Futures	06/17/2021	4	541,702	553,773	12,071
TOPIX Index Futures	06/10/2021	1	170,665	176,652	5,987
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	1	131,734	131,937	203
WIG 20 Index Futures	06/18/2021	82	921,580	996,535	74,955
Short					
10 Yr Mini Japan Government Bond Futures	06/11/2021	45	6,190,495	6,205,809	(15,314)
Euro STOXX 50 Index Futures	06/18/2021	6	286,522	297,443	(10,921)
Euro-Bund Futures	06/08/2021	19	3,953,481	3,937,433	16,048
FTSE China A50 Futures	06/29/2021	23	406,326	419,725	(13,399)
Long Gilt Future	09/28/2021	11	1,983,801	1,986,455	(2,654)
MEX BOLSA Index	06/18/2021	16	389,326	403,374	(14,048)
MSCI EAFE Futures	06/18/2021	24	2,655,286	2,804,400	(149,114)
OMXS 30 Index Futures	06/18/2021	51	1,370,878	1,387,105	(16,227)
S&P 500 E-Mini Futures	06/18/2021	35	6,845,168	7,354,375	(509,207)
S&P/TSX 60 Index Futures	06/17/2021	2	374,092	393,295	(19,203)
SGX Nifty 50 Futures	06/24/2021	68	2,086,958	2,104,749	(17,791)
					\$ (583,094)
				Wertsteigerung \$	189,628
				Wertminderung \$	(772,722)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	USD 523	ZAR 7,417	06/17/2021	\$ 14,555
Bank of America, NA	USD 782	PHP 38,174	07/22/2021	14,586
Barclays Bank PLC	EUR 1,382	USD 1,690	06/16/2021	3,963
Barclays Bank PLC	NZD 1,466	USD 1,052	06/16/2021	(9,585)
Barclays Bank PLC	USD 582	JPY 63,773	06/16/2021	(1,452)
Barclays Bank PLC	USD 1,379	MXN 27,856	06/18/2021	16,855
Barclays Bank PLC	KRW 827,876	USD 742	07/22/2021	(1,412)
Barclays Bank PLC	KRW 118,138	USD 106	07/22/2021	105
Barclays Bank PLC	USD 1,096	PHP 53,844	07/22/2021	27,193
Barclays Bank PLC	MYR 1,019	USD 246	09/23/2021	564
Barclays Bank PLC	USD 1,590	MYR 6,566	09/23/2021	(6,438)
Barclays Bank PLC	USD 1,021	MYR 4,246	09/23/2021	2,703
BNP Paribas SA	CHF 850	USD 943	06/16/2021	(2,610)
BNP Paribas SA	USD 2,029	EUR 1,670	06/16/2021	8,040
BNP Paribas SA	USD 2,751	SEK 22,972	06/16/2021	15,432
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD 32	USD 24	06/04/2021	(264)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD 317	USD 262	06/15/2021	(411)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF 288	USD 319	06/15/2021	(1,070)
Brown Brothers Harriman & Co.	DKK 115	USD 19	06/15/2021	(178)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 142	USD 173	06/15/2021	(821)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 114	USD 161	06/15/2021	(1,181)
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS 197	USD 60	06/15/2021	(475)
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK 1,248	USD 150	06/15/2021	801
Brown Brothers Harriman & Co.	SGD 163	USD 122	06/15/2021	(977)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 73	AUD 94	06/15/2021	(563)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 114	HKD 884	06/15/2021	75
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 79	JPY 8,615	06/15/2021	(408)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 121	SEK 1,013	06/15/2021	591
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD 131	USD 102	06/16/2021	(6,511)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 676	USD 822	06/16/2021	(2,531)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 255	USD 361	06/16/2021	(1,171)
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD 226	USD 163	06/16/2021	(1,030)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 104	CAD 131	06/16/2021	4,452
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 109	CHF 98	06/16/2021	106
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 507	JPY 55,082	06/16/2021	(5,364)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 414	NOK 3,435	06/16/2021	(2,973)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 194	SEK 1,619	06/16/2021	849
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 217	GBP 158	06/17/2021	7,008
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 293	ZAR 4,211	06/17/2021	12,013
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN 2,617	USD 130	06/18/2021	(824)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN 742	USD 37	06/18/2021	44
Brown Brothers Harriman & Co.	CZK 35,880	USD 1,649	06/24/2021	(69,236)
Brown Brothers Harriman & Co.	HUF 211,920	USD 698	06/24/2021	(43,630)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 193	CZK 4,172	06/24/2021	6,709
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 209	HUF 62,433	06/24/2021	10,053
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 774	PLN 3,033	06/24/2021	51,299
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK 3,565	USD 418	07/15/2021	(11,298)
Brown Brothers Harriman & Co.	THB 26,438	USD 842	07/15/2021	(4,053)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 293	NOK 2,493	07/15/2021	4,889
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1,524	THB 47,506	07/15/2021	(4,268)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD 92	USD 74	07/16/2021	(1,991)
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD 519	USD 375	07/29/2021	(728)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 984	USD 1,204	08/03/2021	3,198
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 48	JPY 5,227	08/19/2021	(395)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,540	EUR 1,260	06/21/2021	(2,418)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 55,930	AUD 72,086	06/30/2021	(351,222)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 32	GBP 23	06/30/2021	102
Citibank, NA	BRL 2,792	USD 516	06/02/2021	(19,827)
Citibank, NA	AUD 3,064	USD 2,374	06/16/2021	12,036
Citibank, NA	GBP 727	USD 1,025	06/16/2021	(7,001)
Citibank, NA	COP 8,647,920	USD 2,302	07/15/2021	(24,260)
Citibank, NA	PEN 6,255	USD 1,711	07/15/2021	66,202
Credit Suisse International	USD 2,298	CNH 15,023	06/24/2021	61,212
Deutsche Bank AG	AUD 748	USD 579	06/16/2021	2,619
Deutsche Bank AG	CAD 1,185	USD 980	06/16/2021	(962)
Deutsche Bank AG	GBP 976	USD 1,371	06/16/2021	(13,627)
Deutsche Bank AG	USD 2,470	CAD 2,992	06/16/2021	6,190
Deutsche Bank AG	HUF 545,951	USD 1,774	06/24/2021	(137,611)
Deutsche Bank AG	IDR 7,908,102	USD 550	07/15/2021	(968)
Deutsche Bank AG	USD 671	COP 2,481,837	07/15/2021	(3,888)
Deutsche Bank AG	USD 1,894	INR 140,937	07/15/2021	38,075
Deutsche Bank AG	TWD 35,100	USD 1,267	07/22/2021	(8,597)
Deutsche Bank AG	USD 221	RUB 16,356	07/28/2021	804
Goldman Sachs Bank USA	BRL 7,792	USD 1,467	06/02/2021	(28,228)

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Goldman Sachs Bank USA	USD 1,123	BRL 6,035	06/02/2021	\$ 34,823
Goldman Sachs Bank USA	CHF 1,079	USD 1,183	06/16/2021	(17,382)
Goldman Sachs Bank USA	USD 1,265	EUR 1,046	06/16/2021	10,897
Goldman Sachs Bank USA	USD 743	NOK 6,135	06/16/2021	(9,790)
Goldman Sachs Bank USA	CNH 4,226	USD 653	06/24/2021	(10,162)
Goldman Sachs Bank USA	PLN 5,798	USD 1,529	06/24/2021	(48,024)
Goldman Sachs Bank USA	USD 1,463	BRL 7,792	07/02/2021	27,957
Goldman Sachs Bank USA	TWD 30,775	USD 1,097	07/22/2021	(21,323)
Goldman Sachs Bank USA	CHF 573	USD 629	08/05/2021	(9,319)
Goldman Sachs Bank USA	MYR 4,505	USD 1,097	09/23/2021	10,183
HSBC Bank USA	ZAR 26,613	USD 1,813	06/17/2021	(114,192)
HSBC Bank USA	USD 776	IDR 11,472,221	07/15/2021	22,808
JPMorgan Chase Bank, NA	CLP 1,119,347	USD 1,576	07/15/2021	31,491
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 2,036	INR 153,362	07/15/2021	66,056
JPMorgan Chase Bank, NA	RUB 101,494	USD 1,365	07/28/2021	(8,981)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 3,160	RUB 234,918	07/28/2021	20,788
Royal Bank of Scotland PLC	CHF 2,950	USD 3,272	06/16/2021	(8,283)
Royal Bank of Scotland PLC	CLP 253,097	USD 359	07/15/2021	10,061
Royal Bank of Scotland PLC	MYR 8,195	USD 1,979	09/23/2021	2,618
Standard Chartered Bank	USD 341	INR 25,204	07/15/2021	4,795
Standard Chartered Bank	USD 789	PEN 2,885	07/15/2021	(29,992)
Standard Chartered Bank	KRW 593,176	USD 526	07/22/2021	(6,212)
Standard Chartered Bank	TWD 50,316	USD 1,818	07/22/2021	(10,493)
Standard Chartered Bank	USD 946	PHP 45,374	07/22/2021	625
UBS AG	USD 860	BRL 4,549	06/02/2021	12,408
UBS AG	NZD 830	USD 596	06/16/2021	(4,808)
UBS AG	USD 1,089	SEK 9,145	06/16/2021	12,333
UBS AG	USD 655	PLN 2,446	06/24/2021	10,137
				\$ (410,115)
			Wertsteigerung	\$ 671,303
			Wertminderung	\$ (1,081,418)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 830	01/21/2031	3 Month BKBM	1.075%	\$ (48,762)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,940	02/19/2031	3 Month BKBM	1.616%	(47,379)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NOK 12,810	02/19/2031	6 Month NIBOR	1.634%	(18,233)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	2,230	01/21/2031	6 Month NIBOR	1.348%	(9,850)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 460	04/21/2031	3 Month BKBM	1.790%	(6,587)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 620	05/03/2031	0.084%	6 Month LIBOR	(3,355)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 1,440	05/18/2031	3 Month BKBM	1.985%	(2,727)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 310	05/18/2031	0.079%	6 Month LIBOR	(1,439)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NOK 3,440	04/21/2031	6 Month NIBOR	1.755%	(560)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	SEK 40	04/21/2031	3 Month STIBOR	0.786%	(13)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	10	11/17/2030	0.366%	3 Month STIBOR	46
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 310	04/06/2031	0.026%	6 Month LIBOR	139
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NOK 4,720	05/03/2031	6 Month NIBOR	1.786%	777
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 1,370	02/19/2031	(0.054)%	6 Month LIBOR	11,355
					\$ (126,588)
				Wertsteigerung	\$ 12,317
				Wertminderung	\$ (138,905)

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					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
IBOVESPA Futures	3	0.00%	BRL 360	06/16/2021	\$ (3,350)
IBOVESPA Futures	6	0.00%	731	06/16/2021	(4,417)
IBOVESPA Futures	5	0.00%	594	06/16/2021	(6,530)
IBOVESPA Futures	8	0.00%	958	06/16/2021	(9,172)
KOSPI 200 Futures	250,000	0.00%	105,895	06/10/2021	(621)
KOSPI 200 Futures	2,250,000	0.00%	KRW 938,280	06/10/2021	(18,835)
KOSPI 200 Futures	1,000,000	0.00%	428,923	06/10/2021	2,307

AB SICAV I
Alternative Risk Premia Portfolio

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Swiss Marketing Index Futures	10	0.00%	CHF 111	06/18/2021	\$ (3,964)
Tikkurila Oyj	19,848	EURIBOR Plus 0.50%	EUR 629	12/13/2021	63,383
Willis Towers Watson PLC	3,875	LIBOR Plus 0.30%	USD 917	12/13/2021	95,480
Credit Suisse International					
TPXDDVD	117,907	LIBOR Minus 0.45%	JPY 349,349	02/15/2022	(116,259)
TPXDDVD	21,742	LIBOR Minus 0.45%	64,420	02/15/2022	(21,438)
Goldman Sachs International					
Aggreko PLC	82,663	LIBOR Plus 0.35%	GBP 719	01/05/2023	12,437
Arrow Global Group PLC	76,149	LIBOR Plus 0.35%	231	01/05/2023	9,430
Enable Midstream Partners LP	29,013	LIBOR Plus 0.35%	250	01/05/2023	(4,849)
Enable Midstream Partners LP	393	LIBOR Plus 0.35%	3	07/15/2025	(66)
RSA Insurance Group Ltd.	101,712	LIBOR Plus 0.35%	688	01/05/2023	56,540
Shaw Communications, Inc.	31,630	CDOR Plus 0.35%	CAD 1,073	01/05/2023	90,261
Signature Aviation PLC	129,879	LIBOR Plus 0.35%	GBP 723	01/05/2023	3,450
Siltronic AG	5,875	EURIBOR Plus 0.35%	EUR 818	01/05/2023	17,020
JPMorgan Chase Bank, NA					
IHS Markit Ltd.	9,847	LIBOR Plus 0.40%	USD 1,008	08/12/2022	28,556
PNM Resources, Inc.	18,944	LIBOR Plus 0.40%	937	08/12/2022	(6,252)
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Alexion Pharmaceuticals, Inc.	6,281	LIBOR Plus 0.30%	975	12/13/2021	133,534
Magellan Health, Inc.	8,884	LIBOR Plus 0.30%	835	12/13/2021	1,333
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Bank of America, NA					
MLABERP	30,406	0.84%	3,070	08/16/2021	(40,367)
MLABERP	29,832	0.84%	3,029	08/16/2021	(56,260)
MLABJPBB	1,302,628	0.20%	JPY 121,757	02/15/2022	(10,674)
Barclays Bank PLC					
BCCFCTRP	1,400	0.35%	USD 622	12/15/2021	29,965
BCCFCTRP	2,800	0.35%	1,243	03/15/2022	59,930
BCCFHI2P	3,442	0.02%	706	12/15/2021	(1,735)
BCCFHI2P	11,773	0.02%	2,416	04/18/2022	(7,265)
Credit Suisse International					
CSABJPSS	380,302	3 Month LIBOR	JPY 414,963	02/15/2022	78,564
Goldman Sachs International					
Analog Devices, Inc.	250	LIBOR Minus 0.28%	USD 29	01/05/2023	(7,714)
Analog Devices, Inc.	382	LIBOR Minus 0.27%	58	01/05/2023	(11,787)
Analog Devices, Inc.	1,448	LIBOR Minus 0.31%	221	01/05/2023	(44,680)
Analog Devices, Inc.	1,542	LIBOR Minus 0.30%	228	01/05/2023	(47,581)
Analog Devices, Inc.	1,567	LIBOR Plus 0.35%	189	01/05/2023	(48,352)
Analog Devices, Inc.	1,586	LIBOR Minus 0.29%	181	01/05/2023	(48,938)
Canadian Natl Ry Co.	3,504	LIBOR Minus 0.24%	371	07/15/2025	(23,911)
Energy Transfer LP	24,936	LIBOR Minus 0.30%	255	01/05/2023	7,821
Energy Transfer LP	338	LIBOR Minus 0.30%	3	07/15/2025	106
Goodyear Tire & Rubber Co.	11	LIBOR Minus 0.05%	0	01/05/2023	(24)
Goodyear Tire & Rubber Co.	104	LIBOR Minus 0.29%	2	01/05/2023	(229)
Goodyear Tire & Rubber Co.	205	LIBOR Minus 0.06%	4	01/05/2023	(452)
Goodyear Tire & Rubber Co.	369	LIBOR Minus 0.27%	7	01/05/2023	(813)
Goodyear Tire & Rubber Co.	6,194	LIBOR Minus 0.30%	114	01/05/2023	(13,645)
Goodyear Tire & Rubber Co.	6,425	LIBOR Minus 0.31%	105	01/05/2023	(14,153)
Goodyear Tire & Rubber Co.	155	LIBOR Minus 0.06%	3	07/15/2025	(341)
Goodyear Tire & Rubber Co.	1,009	LIBOR Minus 0.30%	20	07/15/2025	(2,223)
GSABFUS2	60,000	0.00%	6,054	10/15/2025	19,200
GSABFUS2	36,424	0.00%	3,675	10/15/2025	11,656
GSISBT10	3,248	0.00%	440	12/15/2021	(3,598)
GSISBT10	13,277	0.00%	1,772	01/18/2022	10,786
GSISE10A	24,193	0.00%	2,048	02/15/2022	40,886
GSISFT10	464	0.00%	57	12/15/2021	1,579
GSISFT10	14,854	0.00%	1,797	01/18/2022	69,709
Herman Miller, Inc.	666	LIBOR Minus 0.07%	27	01/05/2023	(5,483)
Herman Miller, Inc.	3,991	LIBOR Minus 0.30%	158	01/05/2023	(32,858)
ICON PLC	239	LIBOR	42	01/05/2023	(8,796)
ICON PLC	2,232	LIBOR Minus 0.23%	420	01/05/2023	(82,146)
II-VI, Inc.	1,542	LIBOR Minus 0.30%	103	01/05/2023	(306)
II-VI, Inc.	1,923	LIBOR Minus 0.31%	129	01/05/2023	(382)
Independent Bank Corp.	1,417	LIBOR Minus 0.27%	117	01/05/2023	224
Independent Bank Corp.	233	LIBOR Minus 0.29%	18	01/05/2023	37
Independent Bank Corp.	91	LIBOR Minus 0.07%	7	01/05/2023	14
Independent Bank Corp.	89	LIBOR Minus 0.30%	7	01/05/2023	14
Independent Bank Corp.	17	LIBOR Minus 0.06%	1	01/05/2023	3
Kimco Realty Corp.	1,247	LIBOR Minus 0.30%	25	01/05/2023	(1,729)
M & T Bank Corp.	20	LIBOR Minus 0.05%	3	01/05/2023	(88)
M & T Bank Corp.	508	LIBOR Minus 0.28%	80	01/05/2023	(2,244)

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
M & T Bank Corp.	556	LIBOR Minus 0.07%	USD 87	01/05/2023	\$ (2,456)
M & T Bank Corp.	605	LIBOR Minus 0.29%	99	01/05/2023	(2,672)
M & T Bank Corp.	3,203	LIBOR Minus 0.30%	495	01/05/2023	(14,148)
Middleby Corp.	1,734	LIBOR Minus 0.29%	311	01/05/2023	12,173
Middleby Corp.	14	LIBOR Minus 0.06%	3	01/05/2023	98
Middleby Corp.	3	LIBOR Minus 0.05%	1	01/05/2023	21
Middleby Corp.	3	LIBOR Minus 0.27%	1	01/05/2023	21
Middleby Corp.	2,945	LIBOR Minus 0.30%	490	07/15/2025	20,675
New York Community Bancorp	57,352	LIBOR Minus 0.30%	717	01/05/2023	15,510
New York Community Bancorp	18,035	LIBOR Minus 0.29%	207	01/05/2023	4,877
New York Community Bancorp	3,967	LIBOR Minus 0.07%	49	01/05/2023	1,073
New York Community Bancorp	6,372	LIBOR Minus 0.30%	77	07/15/2025	1,723
salesforce.com, Inc.	57	LIBOR Minus 0.29%	13	01/27/2022	(714)
salesforce.com, Inc.	39	LIBOR Minus 0.08%	9	01/05/2023	(488)
salesforce.com, Inc.	290	LIBOR Minus 0.30%	66	01/05/2023	(3,630)
salesforce.com, Inc.	385	LIBOR Minus 0.31%	87	01/05/2023	(4,820)
salesforce.com, Inc.	843	LIBOR Minus 0.29%	189	01/05/2023	(10,553)
JPMorgan Chase Bank, NA					
First Citizens BancShares, Inc.	147	LIBOR Minus 0.30%	123	08/12/2022	(4,690)
First Citizens BancShares, Inc.	1,038	LIBOR Minus 0.31%	859	08/12/2022	(33,120)
Huntington Bancshares, Inc.	6,999	LIBOR Minus 0.31%	95	08/12/2022	(18,226)
Huntington Bancshares, Inc.	55,135	LIBOR Minus 0.30%	728	08/12/2022	(143,578)
JMABRG3C	5,673	0.15%	1,196	10/15/2021	(870)
JMABRG3C	4,606	0.15%	963	12/15/2021	6,882
JMABRG3C	9,622	0.15%	2,029	01/18/2022	(1,476)
Realty Income Corp.	9,469	LIBOR Minus 0.31%	657	08/12/2022	3,288
Realty Income Corp.	2,745	LIBOR Minus 0.28%	185	08/12/2022	953
Realty Income Corp.	2,048	LIBOR Minus 0.30%	139	08/12/2022	711
Realty Income Corp.	1,240	LIBOR Minus 0.32%	85	08/12/2022	431
S&P Global, Inc.	773	LIBOR Minus 0.31%	256	08/12/2022	(36,921)
S&P Global, Inc.	2,021	LIBOR Minus 0.30%	671	08/12/2022	(96,529)
STERIS PLC	6	LIBOR Minus 0.32%	1	08/12/2022	(29)
STERIS PLC	753	LIBOR Minus 0.30%	146	08/12/2022	(3,694)
STERIS PLC	3,056	LIBOR Minus 0.31%	561	08/12/2022	(14,990)
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Advanced Micro Devices	6,325	LIBOR Minus 0.30%	530	12/13/2021	7,534
Advanced Micro Devices	1,958	LIBOR Minus 0.31%	155	12/13/2021	2,332
Advanced Micro Devices	1,766	LIBOR Minus 0.29%	133	12/13/2021	2,104
Advanced Micro Devices	1,652	LIBOR Minus 0.08%	136	12/13/2021	1,968
Aon PLC	258	LIBOR Minus 0.110%	40	12/13/2021	(16,340)
Aon PLC	1,475	LIBOR Minus 0.25%	263	12/13/2021	(93,417)
Aon PLC	2,452	LIBOR Minus 0.30%	517	12/13/2021	(155,293)
Apollo Global Management, Inc.	70	LIBOR Minus 0.31%	3	12/13/2021	(232)
Apollo Global Management, Inc.	377	LIBOR Minus 0.28%	21	12/13/2021	(1,250)
Apollo Global Management, Inc.	1,915	LIBOR Minus 0.27%	108	12/13/2021	(6,350)
Apollo Global Management, Inc.	12,020	LIBOR Minus 0.30%	645	12/13/2021	(39,859)
AstraZeneca PLC	2,732	LIBOR Minus 0.22%	136	12/13/2021	(17,324)
AstraZeneca PLC	3,698	LIBOR Minus 0.23%	186	12/13/2021	(23,450)
AstraZeneca PLC	6,912	LIBOR Minus 0.21%	351	12/13/2021	(43,831)
Huntington Bancshares, Inc.	794	LIBOR Minus 0.29%	10	12/13/2021	(2,698)
Just Eat Takeaway	10,211	EURIBOR Minus 0.35%	EUR 908	12/13/2021	156,744
MSABETFR	44,659	0.14%	USD 4,782	08/16/2021	(4,528)
MSABGPO	62,536	0.20%	6,137	08/16/2021	(104,754)
MSCBVB3U	707	0.50%	502	12/15/2021	(31,637)
MSCBVB3U	2,355	0.50%	1,578	06/15/2022	(10,453)
Performance Food Group Co.	208	LIBOR Minus 0.30%	10	12/13/2021	(367)
RTS Futures	2	0.00%	295	06/17/2021	17,672
RTS Futures	1	0.00%	108	06/17/2021	10,121
RTS Futures	1	0.00%	95	06/17/2021	7,635
RTS Futures	0	0.00%	60	06/17/2021	7,568
RTS Futures	4	0.00%	550	06/17/2021	25,300
Insgesamt					\$ (508,275)
				Wertsteigerung	\$ 1,151,639
				Wertminderung	\$ (1,659,914)
Swaps insgesamt					\$ (634,863)

- (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
BRL	– Brazilian Real
CAD	– Canadian Dollar
CHF	– Swiss Franc
CLP	– Chilean Peso
CNH	– Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
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
MYR	– Malaysian Ringgit
NOK	– Norwegian Krone
NZD	– New Zealand Dollar
PEN	– Peruvian Sol
PHP	– Philippine Peso
PLN	– Polish Zloty
RUB	– Russian Ruble
SEK	– Swedish Krona
SGD	– Singapore Dollar
THB	– Thailand Baht
TWD	– New Taiwan Dollar
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

ADR	– American Depositary Receipt
BIST	– Borsa Istanbul Stock Exchange
BKBM	– Bank Bill Benchmark (New Zealand)
CBT	– Chicago Board of Trade
CDOR	– Canadian Dealer Offered Rate
EAFE	– Europe, Australia, and Far East
ETS	– Emission Trading Scheme
EURIBOR	– Euro Interbank Offered Rate
FTSE	– Financial Times Stock Exchange
KLCI	– Kuala Lumpur Composite Index
KOSPI	– Korea Composite Stock Price Index
LCH	– London Clearing House
LIBOR	– London Interbank Offered Rate
MSCI	– Morgan Stanley Capital International
NIBOR	– Norwegian Interbank Offered Rate
OMXS	– Stockholm Stock Exchange
REG	– Registered Shares
RTS	– Russian Trading System
SGX	– Singapore Exchange
SPI	– Share Price Index
STIBOR	– Stockholm Interbank Offered Rate
TOPIX	– Tokyo Price Index
TSX	– Toronto Stock Exchange
WIG	– Warszawski Indeks Gieldowy

	Anteile	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	88,237	€ 9,529,596	1.4%
Saab AB - Class B	495,063	11,945,350	1.8
		<u>21,474,946</u>	<u>3.2</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Prysmian SpA	424,507	12,026,283	1.8
INDUSTRIEKONZERNE			
Melrose Industries PLC	4,937,810	9,925,587	1.5
Smiths Group PLC	482,840	8,708,118	1.3
		<u>18,633,705</u>	<u>2.8</u>
MASCHINEN			
Alstom SA	328,758	15,237,933	2.3
Weir Group PLC (The)	395,880	8,846,965	1.3
		<u>24,084,898</u>	<u>3.6</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Teleperformance	33,872	10,652,744	1.6
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
AerCap Holdings NV	191,782	9,288,789	1.4
		<u>96,161,365</u>	<u>14.4</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
ConvaTec Group PLC	5,451,560	15,076,368	2.3
Geringe AB - Class B	500,922	14,562,374	2.2
Smith & Nephew PLC	577,710	10,358,601	1.5
		<u>39,997,343</u>	<u>6.0</u>
PHARMAZEUTIKA			
GlaxoSmithKline PLC	805,790	12,607,102	1.9
Roche Holding AG	91,570	26,358,627	3.9
Sanofi	148,250	13,040,070	2.0
		<u>52,005,799</u>	<u>7.8</u>
		<u>92,003,142</u>	<u>13.8</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank of Ireland Group PLC	2,770,143	14,604,194	2.2
BNP Paribas SA	239,140	13,506,627	2.0
KBC Group NV	189,570	12,735,313	1.9
Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	991,259	9,690,548	1.5
		<u>50,536,682</u>	<u>7.6</u>
KAPITALMÄRKTE			
Euronext NV	232,013	20,231,534	3.0
Quilter PLC	2,661,579	4,761,488	0.7
		<u>24,993,022</u>	<u>3.7</u>
VERSICHERUNGEN			
ASR Nederland NV	99,540	3,511,771	0.5
NN Group NV	162,540	6,777,918	1.0
		<u>10,289,689</u>	<u>1.5</u>
		<u>85,819,393</u>	<u>12.8</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Faurecia SE	257,769	11,627,960	1.7
Pirelli & C SpA	129,930	628,861	0.1
		<u>12,256,821</u>	<u>1.8</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Stellantis NV	856,879	13,776,900	2.1
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Entain PLC	871,454	16,731,169	2.5
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Persimmon PLC	288,130	10,597,540	1.6
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
HUGO BOSS AG	358,660	16,727,902	2.5
Pandora A/S	124,554	13,837,802	2.1
		<u>30,565,704</u>	<u>4.6</u>
		<u>83,928,134</u>	<u>12.6</u>

		Anteile	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
VERBRAUCHSGÜTER				
GETRÄNKE				
	Carlsberg A/S - Class B	91,460	€ 13,799,021	2.1%
	Pernod Ricard SA	71,350	12,928,620	1.9
			<u>26,727,641</u>	<u>4.0</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL				
	Koninklijke Ahold Delhaize NV	631,790	15,058,715	2.2
	Tesco PLC	3,073,653	7,986,855	1.2
			<u>23,045,570</u>	<u>3.4</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE				
	Mowi ASA	233,020	4,983,885	0.8
	Nestle SA (REG)	60,300	6,111,420	0.9
	Salmar ASA	76,990	4,671,517	0.7
			<u>15,766,822</u>	<u>2.4</u>
TABAK				
	Swedish Match AB	1,368,100	10,391,794	1.6
			<u>75,931,827</u>	<u>11.4</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE				
IT-DIENSTLEISTUNGEN				
	TietoEVRY Oyj	210,750	5,643,885	0.9
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG				
	ASM International NV	56,560	14,496,328	2.2
	NXP Semiconductors NV	58,950	10,231,260	1.5
			<u>24,727,588</u>	<u>3.7</u>
SOFTWARE				
	Avast PLC	1,830,656	10,035,919	1.5
			<u>40,407,392</u>	<u>6.1</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN				
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE				
	Deutsche Telekom AG (REG)	731,730	12,500,875	1.9
	Eurazeo SE	183,763	13,341,194	2.0
	Orange SA	553,480	5,798,256	0.8
			<u>31,640,325</u>	<u>4.7</u>
UNTERHALTUNG				
	Ubisoft Entertainment SA	144,100	8,631,590	1.3
			<u>40,271,915</u>	<u>6.0</u>
GRUNDSTOFFE				
CHEMIKALIEN				
	Akzo Nobel NV	137,755	14,409,173	2.1
	Arkema SA	84,919	9,234,941	1.4
			<u>23,644,114</u>	<u>3.5</u>
BAUMATERIAL				
	CRH PLC	326,520	14,024,034	2.1
			<u>37,668,148</u>	<u>5.6</u>
VERSORGUNG				
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE				
	EDP - Energias de Portugal SA	3,743,382	17,885,879	2.7
	Enel SpA	2,326,011	18,940,708	2.8
			<u>36,826,587</u>	<u>5.5</u>
IMMOBILIEN				
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG				
	Aroundtown SA	1,892,123	13,104,844	2.0
	CA Immobilien Anlagen AG	272,649	9,719,937	1.4
	IWG PLC	2,255,460	9,450,768	1.4
			<u>32,275,549</u>	<u>4.8</u>
ENERGIE				
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE				
	Subsea 7 SA	742,220	6,052,393	0.9
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE				
	Royal Dutch Shell PLC - Class B	983,617	14,695,529	2.2
			<u>20,747,922</u>	<u>3.1</u>
Gesamtanlagen				
	(Kosten €541,110,251).....		<u>€642,041,374</u>	<u>96.1%</u>

	Zinssatz	Datum	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Termineinlagen				
ANZ, London(a)	(0.13)%	—	€ 370	0.0%
BNP Paribas, Paris(a)	(0.53)%	—	50,189	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	0.00 %	—	78	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(a)	(1.44)%	—	64,915	0.0
DBS Bank Ltd, Singapore(a)	0.01 %	—	15,521	0.0
Nordea Bank Abp, Oslo(a)	(0.13)%	—	63,444	0.0
SEB, Stockholm(a)	(0.78)%	—	9,621,401	1.5
SEB, Stockholm(a)	(0.28)%	—	64,954	0.0
Sumitomo, Tokyo(a)	0.01 %	—	162,586	0.0
Termineinlagen insgesamt			10,043,458	1.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			15,855,320	2.4
Nettovermögen			€ 667,940,152	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA.	GBP 3,543	EUR 4,089	06/17/2021	\$ (34,259)
Bank of America, NA.	GBP 1,140	EUR 1,330	06/17/2021	3,321
Bank of America, NA.	EUR 3,241	SEK 32,838	07/15/2021	(2,790)
BNP Paribas SA	EUR 5,806	SEK 58,867	07/15/2021	(2,208)
BNP Paribas SA	EUR 16,885	CHF 18,499	08/05/2021	(5,884)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 2,970	EUR 3,438	06/17/2021	(17,220)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 67	NOK 676	07/15/2021	(1,038)
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK 21,882	EUR 2,169	07/15/2021	20,753
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 527	HKD 4,994	06/21/2021	959
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 12,937	AUD 20,383	06/30/2021	(56,316)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 1,968	SGD 3,186	06/30/2021	6,585
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 15,605	USD 19,081	06/30/2021	33,044
Citibank, NA	EUR 4,821	GBP 4,163	06/17/2021	23,245
Citibank, NA	GBP 428	EUR 499	06/17/2021	1,544
Citibank, NA	EUR 1,656	CHF 1,813	08/05/2021	(1,349)
Deutsche Bank AG.	NOK 92,176	EUR 9,065	07/15/2021	15,711
Deutsche Bank AG.	EUR 44,026	CHF 48,291	08/05/2021	37,359
JPMorgan Chase Bank, NA	USD 14,167	EUR 11,552	08/03/2021	(63,744)
Morgan Stanley & Co., Inc.	CHF 1,726	EUR 1,575	08/05/2021	(245)
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 2,542	SEK 25,754	07/15/2021	(2,423)
State Street Bank & Trust Co.	EUR 16,205	GBP 14,014	06/17/2021	102,183
State Street Bank & Trust Co.	GBP 1,481	EUR 1,705	06/17/2021	(18,282)
State Street Bank & Trust Co.	EUR 1,698	NOK 17,017	07/15/2021	(27,669)
State Street Bank & Trust Co.	USD 1,773	EUR 1,447	08/03/2021	(6,450)
UBS AG	SEK 117,459	EUR 11,494	07/15/2021	(86,840)
				\$ (82,013)
			Wertsteigerung	\$ 244,704
			Wertminderung	\$ (326,717)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) 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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

		Anteile	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE				
STAMMAKTIE				
FINANZWERT				
BANKEN				
	Bank of Ireland Group PLC	4,866,380	€ 25,655,555	3.0%
	BNP Paribas SA	307,106	17,345,347	2.0
	KBC Group NV	299,173	20,098,442	2.4
	Mediobanca Banca di Credito Finanziario SpA	1,310,966	12,816,004	1.5
			<u>75,915,348</u>	<u>8.9</u>
KAPITALMÄRKTE				
	Azimut Holding SpA	583,246	11,793,234	1.4
	Euronext NV	294,112	25,646,566	3.0
			<u>37,439,800</u>	<u>4.4</u>
VERSICHERUNGEN				
	ASR Nederland NV	211,507	7,461,967	0.9
	NN Group NV	320,461	13,363,224	1.5
	Talanx AG	415,800	14,436,576	1.7
			<u>35,261,767</u>	<u>4.1</u>
			<u>148,616,915</u>	<u>17.4</u>
INDUSTRIEGÜTER				
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG				
	Airbus SE	174,809	18,879,372	2.2
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG				
	Prismian SpA	533,381	15,110,684	1.8
	TKH Group NV	218,733	9,497,387	1.1
			<u>24,608,071</u>	<u>2.9</u>
INDUSTRIEKONZERNE				
	Rheinmetall AG	120,693	10,331,321	1.2
MASCHINEN				
	Alstom SA	427,957	19,835,807	2.3
	KION Group AG	174,310	15,206,804	1.8
			<u>35,042,611</u>	<u>4.1</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN				
	Teleperformance	48,231	15,168,649	1.8
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER				
	AerCap Holdings NV	366,608	17,756,329	2.1
			<u>121,786,353</u>	<u>14.3</u>
GRUNDSTOFFE				
CHEMIKALIEN				
	Akzo Nobel NV	195,775	20,478,065	2.4
	Arkema SA	148,334	16,131,322	1.9
	Evonik Industries AG	451,381	13,302,198	1.5
			<u>49,911,585</u>	<u>5.8</u>
BAUMATERIAL				
	CRH PLC	416,718	17,898,038	2.1
CONTAINER UND VERPACKUNGEN				
	Smurfit Kappa Group PLC	461,645	20,149,715	2.4
			<u>87,959,338</u>	<u>10.3</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER				
KFZ-BESTANDTEILE				
	Faurecia SE	426,266	19,228,859	2.2
	Pirelli & C SpA	213,076	1,031,288	0.1
			<u>20,260,147</u>	<u>2.3</u>
KRAFTFAHRZEUGE				
	Stellantis NV	1,532,316	24,636,577	2.9
	Volkswagen AG (Preference Shares)	68,300	15,446,045	1.8
			<u>40,082,622</u>	<u>4.7</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER				
	HUGO BOSS AG	454,814	21,212,525	2.5
			<u>81,555,294</u>	<u>9.5</u>
VERBRAUCHSGÜTER				
GETRÄNKE				
	Pernod Ricard SA	122,103	22,125,064	2.6
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL				
	Koninklijke Ahold Delhaize NV	981,898	23,403,539	2.7

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
LEBENSMITTELPRODUKTE					
Mowi ASA			292,890	€ 6,264,398	0.7%
Salmar ASA			166,600	10,108,778	1.2
				<u>16,373,176</u>	<u>1.9</u>
HAUSHALTSPRODUKTE					
Henkel AG & Co. KGaA			111,345	9,069,050	1.1
				<u>70,970,829</u>	<u>8.3</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
EDP - Energias de Portugal SA			6,065,702	28,981,924	3.4
Enel SpA			4,179,570	34,034,239	4.0
				<u>63,016,163</u>	<u>7.4</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
TietoEVRY Oyj			414,213	11,092,624	1.3
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG					
ASM International NV(a)			114,295	29,293,808	3.4
NXP Semiconductors NV			94,521	16,404,901	1.9
				<u>45,698,709</u>	<u>5.3</u>
				<u>56,791,333</u>	<u>6.6</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Deutsche Telekom AG (REG)			1,173,917	20,055,198	2.3
Eurazeo SE			232,949	16,912,097	2.0
Orange SA			793,158	8,309,123	1.0
				<u>45,276,418</u>	<u>5.3</u>
UNTERHALTUNG					
Ubisoft Entertainment SA			184,362	11,043,284	1.3
				<u>56,319,702</u>	<u>6.6</u>
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Neste Oyj			310,387	16,791,937	2.0
Repsol SA			1,218,725	13,362,101	1.6
TOTAL SA			640,296	24,424,091	2.8
				<u>54,578,129</u>	<u>6.4</u>
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF					
Koninklijke Philips NV			295,454	13,692,816	1.6
PHARMAZEUTIKA					
Sanofi			397,749	34,986,002	4.1
				<u>48,678,818</u>	<u>5.7</u>
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Aroundtown SA			2,835,681	19,639,926	2.3
CA Immobilien Anlagen AG			424,181	15,122,053	1.8
				<u>34,761,979</u>	<u>4.1</u>
Gesamtanlagen				<u>€ 825,034,853</u>	<u>96.6%</u>
(Kosten €683,872,118)					
Termineinlagen					
BNP Paribas, Paris(b)	(0.13)%	—		17	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	—		93	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.78)%	—		28,098,636	3.3
Sumitomo, Tokyo(b)	0.01 %	—		<u>45,994</u>	<u>0.0</u>
Termineinlagen insgesamt				<u>28,144,740</u>	<u>3.3</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>986,100</u>	<u>0.1</u>
Nettovermögen				<u>€ 854,165,693</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	2,580	AUD	4,065	06/30/2021	€ (11,269)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	185	PLN	831	06/30/2021	446
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	86	SGD	139	06/30/2021	286
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	108,817	USD	133,045	06/30/2021	226,336
Citibank, NA	NOK	156,248	EUR	15,550	06/15/2021	202,753
Goldman Sachs Bank USA	USD	16,611	EUR	13,682	06/15/2021	48,891
State Street Bank & Trust Co.	USD	1,753	EUR	1,434	06/15/2021	(4,552)
						€ 462,891
					Wertsteigerung	€ 478,712
					Wertminderung	€ (15,821)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
 EUR – Euro
 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 GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Arista Networks, Inc.	153,671	\$ 52,152,864	0.8%
Motorola Solutions, Inc.	117,703	24,165,603	0.4
		<u>76,318,467</u>	<u>1.2</u>
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Amphenol Corp. - Class A	620,013	41,702,074	0.6
Cognex Corp.	367,249	29,155,898	0.5
IPG Photonics Corp.	291,557	61,011,218	1.0
		<u>131,869,190</u>	<u>2.1</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
EPAM Systems, Inc.	107,957	51,560,263	0.8
PayPal Holdings, Inc.	615,506	160,043,870	2.5
Visa, Inc. - Class A	1,345,416	305,813,057	4.8
		<u>517,417,190</u>	<u>8.1</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
ASML Holding NV (ADR)	148,194	100,100,601	1.6
NVIDIA Corp.	184,194	119,685,578	1.9
QUALCOMM, Inc.	1,120,195	150,711,035	2.3
Texas Instruments, Inc.	196,344	37,270,018	0.6
Xilinx, Inc.	773,980	98,295,460	1.5
		<u>506,062,692</u>	<u>7.9</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	332,006	167,523,588	2.6
Fortinet, Inc.	468,604	102,408,718	1.6
Microsoft Corp.	1,956,212	488,427,012	7.6
Tyler Technologies, Inc.	91,109	36,731,504	0.6
		<u>795,090,822</u>	<u>12.4</u>
		<u>2,026,758,361</u>	<u>31.7</u>
GESUNDHEITSWESSEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Regeneron Pharmaceuticals, Inc.	164,267	82,532,669	1.3
Vertex Pharmaceuticals, Inc.	570,659	119,056,587	1.9
		<u>201,589,256</u>	<u>3.2</u>
GESUNDHEITSWESSEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
ABIOMED, Inc.	82,242	23,404,429	0.3
Align Technology, Inc.	182,961	107,974,434	1.7
Edwards Lifesciences Corp.	1,213,871	116,410,229	1.8
IDEXX Laboratories, Inc.	145,202	81,038,688	1.3
Intuitive Surgical, Inc.	204,928	172,586,263	2.7
		<u>501,414,043</u>	<u>7.8</u>
GESUNDHEITSWESSEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
UnitedHealth Group, Inc.	745,542	307,103,661	4.8
GESUNDHEITSWESSEN – TECHNOLOGIE			
Veeva Systems, Inc. - Class A	147,745	43,044,028	0.7
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Illumina, Inc.	92,017	37,325,776	0.6
Mettler-Toledo International, Inc.	24,013	31,239,712	0.5
		<u>68,565,488</u>	<u>1.1</u>
PHARMAZEUTIKA			
Zoetis, Inc.	1,305,682	230,687,896	3.6
		<u>1,352,404,372</u>	<u>21.2</u>
KOMMUNIKATIONS-DIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	526,730	75,285,519	1.2
Take-Two Interactive Software, Inc.	298,100	55,315,436	0.8
		<u>130,600,955</u>	<u>2.0</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	217,340	524,128,450	8.2
Facebook, Inc. - Class A	1,057,550	347,648,412	5.5
		<u>871,776,862</u>	<u>13.7</u>
		<u>1,002,377,817</u>	<u>15.7</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE					
Chegg, Inc.			441,171	\$ 33,930,462	0.5%
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT					
Domino's Pizza, Inc.			129,196	55,149,896	0.9
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB					
Amazon.com, Inc.			113,033	364,313,271	5.7
Etsy, Inc.			296,657	48,868,308	0.8
				413,181,579	6.5
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL					
Burlington Stores, Inc.			69,637	22,518,517	0.4
Home Depot, Inc. (The)			582,555	185,782,615	2.9
				208,301,132	3.3
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER					
NIKE, Inc. - Class B			1,230,989	167,980,759	2.6
				878,543,828	13.8
VERBRAUCHSGÜTER					
GETRÄNKE					
Monster Beverage Corp.			2,069,412	195,083,469	3.1
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Costco Wholesale Corp.			388,616	147,001,775	2.3
				342,085,244	5.4
INDUSTRIEGÜTER					
BAUPRODUKTE					
Allegion PLC			335,861	47,181,753	0.7
Trex Co., Inc.			244,144	23,782,067	0.4
				70,963,820	1.1
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF					
Copart, Inc.			624,842	80,610,867	1.2
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG					
AMETEK, Inc.			222,640	30,078,664	0.5
INDUSTRIEKONZERNE					
Roper Technologies, Inc.			209,239	94,159,642	1.5
MASCHINEN					
IDEX Corp.			145,055	32,297,946	0.5
				308,110,939	4.8
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Sherwin-Williams Co. (The)			348,206	98,726,847	1.5
FINANZWERTE					
KAPITALMÄRKTE					
MarketAxess Holdings, Inc.			35,606	16,611,623	0.3
Gesamtanlagen				\$ 6,025,619,031	94.4%
(Kosten \$3,648,223,948)					
Termineinlagen					
BNP Paribas, Paris(a)	(0.13)%	—		48,001	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	0.00 %	—		1	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	2.99 %	—		484,310	0.0
Citibank, New York(a)	0.01 %	—		355,617,963	5.6
Nordea Bank Abp, Oslo(a)	(0.78)%	—		17,335	0.0
Termineinlagen insgesamt				356,167,610	5.6
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				2,748,050	0.0
Nettovermögen				\$ 6,384,534,691	100.0%

DEVEISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	576	CNH	3,739	06/07/2021	\$ 11,153
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	59,390	AUD	76,548	06/30/2021	(371,839)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	96,885	EUR	79,239	06/30/2021	(204,508)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,599	GBP	1,130	06/30/2021	5,085
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	16,606	PLN	61,100	06/30/2021	15,315
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	10,406	SGD	13,786	06/30/2021	16,897
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	31,399	ZAR	435,819	06/30/2021	108,483
						<u>\$ (419,414)</u>
					Wertsteigerung	\$ 156,933
					Wertminderung	\$ (576,347)

+ 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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INVESTITIONSGÜTER			
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Shimizu Corp.	979	\$ 8,004	0.0%
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
AT&T, Inc.	12,932	380,589	0.0
BCE, Inc.	128	6,364	0.0
Comcast Corp. - Class A	20,096	1,152,304	0.0
Elisa Oyj	252	14,944	0.0
HKT Trust & HKT Ltd. - Class SS	6,718	9,176	0.0
Lumen Technologies, Inc.	23,206	321,171	0.0
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	74,583	2,016,766	0.2
Orange SA	9,350	119,446	0.0
Shaw Communications, Inc. - Class B	816	24,398	0.0
Spark New Zealand Ltd.	326,635	1,063,581	0.1
Swisscom AG	46	26,020	0.0
Telefonica SA	347,358	1,708,109	0.1
Telenor ASA	33,946	591,001	0.1
TELUS Corp.	759	17,127	0.0
Verizon Communications, Inc.	7,504	423,901	0.1
Washington H Soul Pattinson & Co., Ltd.	191	4,373	0.0
		<u>7,879,270</u>	<u>0.6</u>
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	13,916	1,353,428	0.0
Electronic Arts, Inc.	14,588	2,085,063	0.2
Netflix, Inc.	1,693	851,258	0.1
Nintendo Co., Ltd.	899	556,335	0.1
Take-Two Interactive Software, Inc.	1,320	244,939	0.0
Ubisoft Entertainment SA	6,504	475,084	0.0
		<u>5,566,107</u>	<u>0.4</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class A	601	1,416,467	0.1
Alphabet, Inc. - Class C	1,883	4,540,967	0.4
Auto Trader Group PLC	159,640	1,272,305	0.1
Facebook, Inc. - Class A	34,508	11,343,815	0.9
Kakaku.com, Inc.	26,600	794,356	0.0
		<u>19,367,910</u>	<u>1.5</u>
MEDIEN			
Fox Corp. - Class B	6,310	228,927	0.0
iHeartMedia, Inc. - Class A	1,495	34,699	0.0
Interpublic Group of Cos., Inc. (The)	45,051	1,517,768	0.1
Omnicom Group, Inc.	390	32,074	0.0
ViacomCBS, Inc. - Class B	1,029	43,650	0.0
		<u>1,857,118</u>	<u>0.1</u>
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
KDDI Corp.	2,860	97,621	0.0
Rogers Communications, Inc. - Class B	628	32,423	0.0
SoftBank Corp.	137,594	1,769,486	0.1
Tele2 AB - Class B	888	12,105	0.0
Vodafone Group PLC	463,073	843,149	0.1
		<u>2,754,784</u>	<u>0.2</u>
		<u>37,425,189</u>	<u>2.8</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aisin Corp.	33,300	1,459,821	0.1
Aptiv PLC	31,389	4,721,533	0.4
Bridgestone Corp.	1,012	45,065	0.0
Magna International, Inc. - Class A (United States)	506	50,883	0.0
		<u>6,277,302</u>	<u>0.5</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Bayerische Motoren Werke AG	6,831	726,465	0.1
Daimler AG	15,303	1,430,198	0.1
Porsche Automobil Holding SE (Preference Shares)	272	30,303	0.0
Tesla, Inc.	3,566	2,229,535	0.2
Toyota Motor Corp.	3,762	312,886	0.0
		<u>4,729,387</u>	<u>0.4</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERTRIEBSSTELLEN			
Genuine Parts Co.	262	\$ 34,353	0.0%
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	51,916	1,677,260	0.1
Chipotle Mexican Grill, Inc. - Class A	282	386,898	0.0
Compass Group PLC	63,176	1,442,120	0.0
Darden Restaurants, Inc.	3,147	450,745	0.1
McDonald's Corp.	5,077	1,187,459	0.1
Starbucks Corp.	15,848	1,804,770	0.2
		<u>6,949,252</u>	<u>0.5</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Casio Computer Co., Ltd.	344	6,032	0.0
Electrolux AB - Class B	55,849	1,591,238	0.1
Garmin Ltd.	6,880	978,612	0.0
Husqvarna AB - Class B	741	10,931	0.0
Iida Group Holdings Co., Ltd.	261	7,055	0.0
Lennar Corp. - Class A	2,130	210,891	0.0
Persimmon PLC	5,445	244,182	0.0
PulteGroup, Inc.	7,940	458,853	0.1
Sekisui Chemical Co., Ltd.	676	11,854	0.0
Sekisui House Ltd.	1,093	23,107	0.0
Sony Corp.	6,700	669,176	0.2
Sony Group Corp.	6,700	669,176	0.0
Whirlpool Corp.	114	27,028	0.0
		<u>4,908,135</u>	<u>0.4</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Amazon.com, Inc.	3,925	12,650,550	0.9
eBay, Inc.	16,556	1,007,929	0.1
HelloFresh SE	10,333	935,467	0.1
MercadoLibre, Inc.	694	942,917	0.1
Zalando SE	5,690	608,799	0.0
		<u>16,145,662</u>	<u>1.2</u>
FREIZEITPRODUKTE			
Hasbro, Inc.	6,499	623,709	0.0
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Canadian Tire Corp., Ltd. - Class A	102	17,458	0.0
Dollar General Corp.	2,556	518,968	0.0
Target Corp.	4,167	945,576	0.1
Wesfarmers Ltd.	2,011	86,087	0.0
		<u>1,568,089</u>	<u>0.1</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
ABC-Mart, Inc.	58	3,337	0.0
AutoZone, Inc.	1,728	2,429,200	0.4
Best Buy Co., Inc.	2,243	260,727	0.0
Home Depot, Inc. (The)	13,054	4,163,051	0.3
O'Reilly Automotive, Inc.	1,380	738,464	0.0
Ross Stores, Inc.	7,716	975,224	0.0
TJX Cos., Inc. (The)	59,488	4,017,820	0.3
Tractor Supply Co.	2,625	476,963	0.0
USS Co., Ltd.	388	6,857	0.0
		<u>13,071,643</u>	<u>1.0</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Deckers Outdoor Corp.	5,008	1,680,219	0.1
NIKE, Inc. - Class B	36,096	4,925,660	0.4
Pandora A/S	6,362	861,940	0.1
		<u>7,467,819</u>	<u>0.6</u>
		<u>61,775,351</u>	<u>4.7</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Asahi Group Holdings Ltd.	809	39,259	0.0
Coca-Cola Co. (The)	25,002	1,382,360	0.1
Coca-Cola HBC AG	355	12,943	0.0
Kirin Holdings Co., Ltd.	1,459	29,463	0.0
PepsiCo, Inc.	2,502	370,146	0.0
Treasury Wine Estates Ltd.	1,279	11,575	0.0
		<u>1,845,746</u>	<u>0.1</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Etablissements Franz Colruyt NV	96	5,849	0.0
ICA Gruppen AB	178	8,731	0.0
Kesko Oyj - Class B	484	16,833	0.0
Koninklijke Ahold Delhaize NV	61,580	1,789,859	0.1
Seven & i Holdings Co., Ltd.	1,336	58,982	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Sysco Corp.	925	\$ 74,925	0.0%
Tesco PLC	13,714	43,449	0.0
Walmart, Inc.	13,440	1,908,740	0.2
Wm Morrison Supermarkets PLC	4,274	10,727	0.0
Woolworths Group Ltd.	2,244	72,500	0.0
		<u>3,990,595</u>	<u>0.3</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Bunge Ltd.	7,914	687,093	0.1
Campbell Soup Co.	357	17,375	0.0
Conagra Brands, Inc.	885	33,719	0.0
Danone SA	1,157	82,481	0.0
General Mills, Inc.	1,108	69,649	0.0
JM Smucker Co. (The)	199	26,525	0.0
Kellogg Co.	3,142	205,770	0.0
MEIJI Holdings Co., Ltd.	216	13,451	0.0
Morinaga & Co., Ltd./Japan	15,400	479,520	0.0
Nestle SA	12,928	1,597,064	0.1
Orkla ASA	1,332	13,895	0.0
Salmar ASA	27,600	2,038,160	0.2
Tyson Foods, Inc. - Class A	531	42,215	0.0
Wilmar International Ltd.	3,407	12,340	0.0
		<u>5,319,257</u>	<u>0.4</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
Clorox Co. (The)	228	40,294	0.0
Essity AB - Class B	1,079	37,369	0.0
Henkel AG & Co. KGaA	184	18,276	0.0
Kimberly-Clark Corp.	614	80,207	0.0
Procter & Gamble Co. (The)	16,352	2,205,067	0.2
Reckitt Benckiser Group PLC	1,264	114,230	0.0
		<u>2,495,443</u>	<u>0.2</u>
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Unilever PLC	4,663	279,689	0.0
TABAK			
Altria Group, Inc.	43,191	2,125,861	0.2
British American Tobacco PLC	3,865	148,809	0.0
Imperial Brands PLC	77,659	1,763,356	0.1
Japan Tobacco, Inc.	2,128	42,392	0.0
Philip Morris International, Inc.	38,873	3,748,523	0.3
Swedish Match AB	216,752	2,009,808	0.2
		<u>9,838,749</u>	<u>0.8</u>
		<u>23,769,479</u>	<u>1.8</u>
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE			
Baker Hughes Co. - Class A	1,321	32,233	0.0
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
Bonanza Creek Energy, Inc.	313	13,446	0.0
Denbury, Inc.	2,757	184,774	0.0
Enagas SA	441	10,363	0.0
Exxon Mobil Corp.	21,178	1,236,160	0.1
Galp Energia SGPS SA	28,901	362,478	0.0
Gulfport Energy Corp.	22,919	1,432,437	0.1
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	35,600	847,580	0.1
Lundin Energy AB	355	12,179	0.0
Marathon Petroleum Corp.	1,180	72,924	0.0
ONEOK, Inc.	3,780	199,357	0.0
Parkland Corp./Canada	5,499	180,212	0.0
Pembina Pipeline Corp.	975	31,517	0.0
Repsol SA	83,356	1,114,474	0.1
Royal Dutch Shell PLC - Class B	82,672	1,505,935	0.1
TC Energy Corp.	1,667	85,154	0.0
Valero Energy Corp.	25,087	2,016,995	0.2
Whiting Petroleum Corp.	1,263	57,833	0.0
		<u>9,363,818</u>	<u>0.7</u>
		<u>9,396,051</u>	<u>0.7</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	150,272	1,205,776	0.0
Bank of America Corp.	12,496	529,620	0.0
BOC Hong Kong Holdings Ltd.	6,563	24,186	0.0
Chiba Bank Ltd. (The)	940	6,119	0.0
Citigroup, Inc.	17,656	1,389,704	0.1
Citizens Financial Group, Inc.	770	38,423	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Concordia Financial Group Ltd.	1,930	\$ 7,327	0.0%
Credit Agricole SA	63,292	949,486	0.1
DBS Group Holdings Ltd.	47,198	1,085,286	0.1
Fifth Third Bancorp	46,825	1,973,206	0.2
Hang Seng Bank Ltd.	1,356	28,864	0.0
Huntington Bancshares, Inc./OH	1,844	29,246	0.0
JPMorgan Chase & Co.	8,612	1,414,272	0.0
KBC Group NV	8,712	713,628	0.0
KeyCorp	1,742	40,136	0.0
Lloyds Banking Group PLC	291,370	206,294	0.0
M&T Bank Corp.	232	37,280	0.0
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	122,400	703,520	0.0
National Bank of Canada	1,470	114,723	0.0
Nordea Bank Abp	168,897	1,835,379	0.2
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	65,954	623,384	0.1
PNC Financial Services Group, Inc. (The)	769	149,709	0.0
Regions Financial Corp.	1,742	40,780	0.0
Royal Bank of Canada	20,156	2,096,040	0.4
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	35,500	1,301,575	0.1
Toronto-Dominion Bank (The)	11,652	839,672	0.0
Truist Financial Corp.	2,443	150,929	0.0
United Overseas Bank Ltd.	2,090	41,531	0.0
US Bancorp	18,391	1,117,805	0.1
		<u>18,693,900</u>	<u>1.4</u>
KAPITALMÄRKTE			
3i Group PLC	1,726	30,447	0.0
ASX Ltd.	343	20,210	0.0
Bank of New York Mellon Corp. (The)	1,513	78,797	0.0
Charles Schwab Corp. (The)	75,652	5,586,900	0.4
CME Group, Inc. - Class A	9,998	2,187,163	0.2
EQT AB	3,320	120,820	0.0
Franklin Resources, Inc.	48,334	1,653,506	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	5,897	2,193,802	0.2
Hargreaves Lansdown PLC	630	14,815	0.0
IGM Financial, Inc.	50,842	1,871,565	0.2
Magellan Financial Group Ltd.	244	9,085	0.0
Morgan Stanley	7,722	702,316	0.1
Northern Trust Corp.	359	43,507	0.0
Partners Group Holding AG	1,173	1,773,519	0.1
S&P Global, Inc.	3,772	1,430,600	0.0
Schroders PLC	220	11,105	0.0
Singapore Exchange Ltd.	86,825	682,126	0.1
St. James's Place PLC	954	18,920	0.0
State Street Corp.	638	55,493	0.0
T. Rowe Price Group, Inc.	7,333	1,403,170	0.1
		<u>19,887,866</u>	<u>1.5</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
Ally Financial, Inc.	7,360	402,665	0.1
Capital One Financial Corp.	1,520	244,386	0.0
Synchrony Financial	1,058	50,160	0.0
		<u>697,211</u>	<u>0.1</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Industrivarden AB	9,180	374,534	0.0
Industrivarden AB - Class C	9,640	377,049	0.0
Kinnevik AB	31,578	870,623	0.1
M&G PLC	538,000	1,866,764	0.1
		<u>3,488,970</u>	<u>0.2</u>
VERSICHERUNGEN			
Admiral Group PLC	342	14,264	0.0
Aflac, Inc.	1,186	67,223	0.0
Allianz SE	3,289	873,345	0.1
Allstate Corp. (The)	549	74,999	0.0
American Financial Group, Inc./OH	133	17,697	0.0
Assicurazioni Generali SpA	1,956	40,180	0.0
Baloise Holding AG	82	13,665	0.0
CNP Assurances	80,176	1,474,870	0.1
Direct Line Insurance Group PLC	2,420	10,210	0.0
Fidelity National Financial, Inc.	13,031	612,327	0.1
Gjensidige Forsikring ASA	354	7,973	0.0
Great-West Lifeco, Inc.	2,753	84,638	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The)	644	42,085	0.0
iA Financial Corp., Inc.	15,252	877,585	0.1
Japan Post Holdings Co., Ltd.	186,400	1,575,240	0.1
Legal & General Group PLC	317,041	1,279,147	0.1

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Lincoln National Corp.	330	\$ 23,031	0.0%
Manulife Financial Corp.	85,732	1,791,214	0.1
Medibank Pvt Ltd.	31,454	75,896	0.0
MetLife, Inc.	28,567	1,867,139	0.1
MS&AD Insurance Group Holdings, Inc.	789	24,259	0.0
NN Group NV	33,007	1,678,441	0.1
Power Corp. of Canada	993	32,386	0.0
Principal Financial Group, Inc.	494	32,303	0.0
Progressive Corp. (The)	6,147	609,045	0.1
Prudential Financial, Inc.	17,957	1,920,860	0.2
Reinsurance Group of America, Inc. - Class A	123	15,502	0.0
RenaissanceRe Holdings Ltd.	97	14,950	0.0
Sampo Oyj - Class A	15,816	752,956	0.0
Sompo Holdings, Inc.	562	22,672	0.0
Swiss Life Holding AG	57	29,752	0.0
Swiss Re AG	535	51,793	0.0
T&D Holdings, Inc.	954	13,037	0.0
Tokio Marine Holdings, Inc.	1,120	52,729	0.0
Travelers Cos., Inc. (The)	457	72,983	0.0
Tryg A/S	638	15,165	0.0
Zurich Insurance Group AG	1,637	689,196	0.1
		<u>16,850,757</u>	<u>1.3</u>
HYPOTHEKEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
AGNC Investment Corp.	96,255	1,784,568	0.2
Annaly Capital Management, Inc.	190,371	1,764,739	0.1
		<u>3,549,307</u>	<u>0.3</u>
		<u>63,168,011</u>	<u>4.8</u>
LEBENSMITTEL, GETRÄNKE UND TABAK			
LANDWIRTSCHAFTLICHE PRODUKTE			
Archer-Daniels-Midland Co.	1,012	67,328	0.0
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
AbbVie, Inc.	24,405	2,762,646	0.2
Amgen, Inc.	7,843	1,866,163	0.1
Gilead Sciences, Inc.	3,010	198,991	0.0
		<u>4,827,800</u>	<u>0.3</u>
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	51,430	5,999,310	0.5
Align Technology, Inc.	278	164,062	0.0
Baxter International, Inc.	20,679	1,698,159	0.1
Coloplast A/S - Class B	3,679	584,953	0.1
Medtronic PLC	14,753	1,867,582	0.1
		<u>10,314,066</u>	<u>0.8</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Anthem, Inc.	4,328	1,723,099	0.2
CVS Health Corp.	2,378	205,554	0.0
Sonic Healthcare Ltd.	805	21,608	0.0
UnitedHealth Group, Inc.	10,695	4,405,484	0.3
		<u>6,355,745</u>	<u>0.5</u>
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Veeva Systems, Inc. - Class A	1,640	477,798	0.0
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	1,353	815,007	0.1
IQVIA Holdings, Inc.	30,938	7,430,070	0.6
Thermo Fisher Scientific, Inc.	1,288	603,777	0.0
		<u>8,848,854</u>	<u>0.7</u>
PHARMAZEUTIKA			
Astellas Pharma, Inc.	3,302	52,926	0.0
AstraZeneca PLC	2,328	265,822	0.0
Bristol-Myers Squibb Co.	14,391	945,776	0.1
Eisai Co., Ltd.	420	28,278	0.0
Eli Lilly & Co.	3,161	631,378	0.1
GlaxoSmithKline PLC	8,923	170,217	0.0
Johnson & Johnson	14,626	2,475,451	0.2
Merck & Co., Inc.	20,007	1,518,331	0.1
Novartis AG (REG)	3,938	348,488	0.0
Novo Nordisk A/S - Class B	17,676	1,398,992	0.0
Orion Oyj - Class B	188	8,306	0.0
Otsuka Holdings Co., Ltd.	692	29,019	0.0
Pfizer, Inc.	10,114	391,715	0.0
Recordati Industria Chimica e Farmaceutica SpA	185	10,330	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Roche Holding AG	10,105	\$ 3,547,015	0.3%
Sanofi	2,010	215,598	0.0
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	53,200	1,823,142	0.2
Zoetis, Inc.	27,272	4,818,417	0.4
		<u>18,679,201</u>	<u>1.4</u>
		<u>49,503,464</u>	<u>3.7</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
BAE Systems PLC	5,711	42,680	0.0
Huntington Ingalls Industries, Inc.	533	115,240	0.0
L3Harris Technologies, Inc.	4,236	923,484	0.1
Singapore Technologies Engineering Ltd.	2,769	8,145	0.0
		<u>1,089,549</u>	<u>0.1</u>
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
Deutsche Post AG	1,758	119,516	0.0
Kuehne & Nagel International AG	4,966	1,677,785	0.1
		<u>1,797,301</u>	<u>0.1</u>
BAUPRODUKTE			
AGC, Inc.	342	15,040	0.0
Cie de Saint-Gobain	13,874	932,894	0.1
Lixil Corp.	9,700	263,795	0.0
Masco Corp.	12,822	773,295	0.1
Xinyi Glass Holdings Ltd.	161,224	630,487	0.0
		<u>2,615,511</u>	<u>0.2</u>
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Copart, Inc.	3,414	440,440	0.0
Securitas AB - Class B	555	9,096	0.0
Stericycle, Inc.	61,021	4,793,810	0.4
Toppan Printing Co., Ltd.	465	8,158	0.0
		<u>5,251,504</u>	<u>0.4</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Bouygues SA	405	16,491	0.0
Kajima Corp.	113,897	1,586,583	0.1
Obayashi Corp.	1,151	9,830	0.0
Taisei Corp.	338	11,986	0.0
		<u>1,624,890</u>	<u>0.1</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
ABB Ltd. (REG)	39,638	1,351,966	0.1
Eaton Corp. PLC	722	104,870	0.0
Emerson Electric Co.	1,088	104,111	0.0
Generac Holdings, Inc.	1,980	651,196	0.0
Mitsubishi Electric Corp.	3,237	50,735	0.0
Regal Beloit Corp.	6,024	856,792	0.1
Rockwell Automation, Inc.	990	261,083	0.1
Schneider Electric SE	7,200	1,146,849	0.1
		<u>4,527,602</u>	<u>0.4</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
3M Co.	6,834	1,387,575	0.1
DCC PLC	175	14,871	0.0
Siemens AG (REG)	1,357	223,232	0.0
		<u>1,625,678</u>	<u>0.1</u>
MASCHINEN			
Cummins, Inc.	6,386	1,642,990	0.1
GEA Group AG	272	11,845	0.0
Kone Oyj - Class B	603	49,076	0.0
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	52,000	1,606,373	0.1
PACCAR, Inc.	14,869	1,361,406	0.1
SKF AB - Class B	55,223	1,496,261	0.1
Snap-on, Inc.	7,084	1,803,728	0.2
Volvo AB	54,433	1,436,785	0.1
		<u>9,408,464</u>	<u>0.7</u>
SCHIFFFAHRT			
Nippon Yusen KK	45,700	1,872,354	0.1
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Adecco Group AG	4,918	341,171	0.0
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	13,712	1,164,644	0.0
Randstad NV	212	16,520	0.0
RELX PLC	70,675	1,850,944	0.2
SGS SA	126	394,319	0.0
Verisk Analytics, Inc. - Class A	17,509	3,026,081	0.4

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Wolters Kluwer NV	12,924	\$ 1,240,956	0.0%
		<u>8,034,635</u>	<u>0.6</u>
STRASSE UND SCHIENE			
Aurizon Holdings Ltd.	3,289	9,254	0.0
Nippon Express Co., Ltd.	136	11,033	0.0
		<u>20,287</u>	<u>0.0</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Bunzl PLC	597	19,359	0.0
Fastenal Co.	25,327	1,343,344	0.1
Ferguson PLC	399	54,269	0.0
ITOCHU Corp.	2,108	63,834	0.0
WW Grainger, Inc.	3,750	1,733,100	0.2
		<u>3,213,906</u>	<u>0.3</u>
		<u>41,081,681</u>	<u>3.1</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Cisco Systems, Inc./Delaware	7,655	404,949	0.0
Juniper Networks, Inc.	590	15,535	0.0
		<u>420,484</u>	<u>0.0</u>
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Amphenol Corp. - Class A	68,454	4,604,216	0.3
Arrow Electronics, Inc.	6,716	808,136	0.1
CDW Corp./DE	25,251	4,177,021	0.3
Hitachi Ltd.	1,716	90,866	0.0
Venture Corp., Ltd.	490	7,136	0.0
		<u>9,687,375</u>	<u>0.7</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Accenture PLC - Class A	1,140	321,662	0.0
Amadeus IT Group SA - Class A	19,540	1,477,264	0.0
Automatic Data Processing, Inc.	26,689	5,231,578	0.4
Broadridge Financial Solutions, Inc.	9,415	1,501,504	0.1
Capgemini SE	8,676	1,624,740	0.4
Computershare Ltd.	961	11,994	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	7,900	1,176,940	0.0
Genpact Ltd.	14,832	678,324	0.0
International Business Machines Corp.	16,980	2,440,706	0.2
Mastercard, Inc. - Class A	23,415	8,442,981	0.7
Nomura Research Institute Ltd.	18,000	575,228	0.0
Paychex, Inc.	25,191	2,547,818	0.2
SCSK Corp.	92	5,503	0.0
Visa, Inc. - Class A	5,580	1,268,332	0.0
Western Union Co. (The) - Class W	26,827	656,457	0.1
		<u>27,961,031</u>	<u>2.1</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Applied Materials, Inc.	5,692	786,236	0.1
ASM International NV	430	134,395	0.0
ASML Holding NV	684	460,676	0.1
Broadcom, Inc.	1,204	567,740	0.0
Intel Corp.	26,932	1,538,356	0.1
KLA Corp.	7,669	2,430,230	0.2
QUALCOMM, Inc.	13,365	1,798,127	0.2
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. (Sponsored ADR)	12,776	1,499,508	0.0
Texas Instruments, Inc.	22,738	4,316,127	0.3
		<u>13,531,395</u>	<u>1.0</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	5,540	2,795,373	0.2
Autodesk, Inc.	1,321	377,621	0.0
Avaya Holdings Corp.	457	13,107	0.0
Cadence Design Systems, Inc.	12,281	1,559,564	0.1
Citrix Systems, Inc.	13,656	1,569,780	0.0
Constellation Software, Inc./Canada	1,112	1,594,588	0.2
CrowdStrike Holdings, Inc. - Class A	3,592	797,963	0.1
Microsoft Corp.	80,342	20,059,790	1.5
NortonLifeLock, Inc.	23,660	654,436	0.0
Oracle Corp.	32,988	2,597,476	0.4
Oracle Corp. Japan	6,600	599,098	0.0
Sage Group PLC (The)	1,944	18,114	0.0
ServiceNow, Inc.	3,275	1,551,957	0.1
Trade Desk, Inc. (The) - Class A	97	57,049	0.0
Trend Micro, Inc./Japan	237	12,083	0.0
Zoom Video Communications, Inc. - Class A	586	194,276	0.0
		<u>34,452,275</u>	<u>2.6</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	88,679	\$ 11,050,290	0.9%
Brother Industries Ltd.	418	8,959	0.0
HP, Inc.	2,260	66,060	0.0
Logitech International SA	6,384	786,132	0.0
NetApp, Inc.	18,657	1,443,492	0.1
Seagate Technology Holdings PLC	7,444	712,762	0.1
		<u>14,067,695</u>	<u>1.1</u>
		<u>100,120,255</u>	<u>7.5</u>
VERSICHERUNGEN			
LEBENS- UND KRANKENVERSICHERUNG			
Sun Life Financial, Inc.	1,037	55,857	0.0
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Akzo Nobel NV	7,752	988,928	0.0
Arkema SA	109	14,455	0.0
Asahi Kasei Corp.	2,225	25,140	0.0
Celanese Corp. - Class A	8,285	1,370,753	0.1
Covestro AG	3,952	276,144	0.0
Dow, Inc.	29,284	2,003,612	0.2
Eastman Chemical Co.	246	30,848	0.0
EMS-Chemie Holding AG	13	12,212	0.0
Evonik Industries AG	10,975	394,411	0.1
Fuchs Petrolub Sf (Preference Shares)	123	6,321	0.0
International Flavors & Fragrances, Inc.	27,162	3,848,040	0.3
Johnson Matthey PLC	20,180	872,328	0.0
JSR Corp.	360	11,013	0.0
LyondellBasell Industries NV - Class A	8,382	943,981	0.1
Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	51,600	419,340	0.1
Mitsubishi Gas Chemical Co., Inc.	280	6,613	0.0
Mitsui Chemicals, Inc.	48,926	1,665,983	0.1
Nitto Denko Corp.	267	21,173	0.0
Nutrien Ltd.	1,009	62,751	0.0
Sika AG	2,098	676,631	0.1
Tosoh Corp.	461	8,248	0.0
Yara International ASA	309	16,479	0.0
		<u>13,675,404</u>	<u>1.1</u>
BAUMATERIAL			
CRH PLC	1,392	72,907	0.0
Holcim Ltd.	928	55,628	0.0
		<u>128,535</u>	<u>0.0</u>
CONTAINER UND VERPACKUNGEN			
Amcor PLC	123,484	1,457,111	0.1
International Paper Co.	677	42,719	0.0
Packaging Corp. of America	172	25,568	0.0
		<u>1,525,398</u>	<u>0.1</u>
DIVERSIFIZIERTE METALLE UND BERGBAU			
Anglo American PLC	2,296	102,150	0.0
METALL UND BERGBAU			
Antofagasta PLC	699	15,321	0.0
B2Gold Corp.	1,865	9,541	0.0
BHP Billiton Ltd.	59,908	2,224,177	0.2
Boliden AB	485	19,484	0.0
Evolution Mining Ltd.	3,030	12,333	0.0
Evrast PLC	183,128	1,657,034	0.1
Fortescue Metals Group Ltd.	107,946	1,840,728	0.1
Rio Tinto Ltd.	2,998	284,318	0.0
Rio Tinto PLC	18,340	1,578,290	0.1
Steel Dynamics, Inc.	32,593	2,034,781	0.2
		<u>9,676,007</u>	<u>0.7</u>
PAPIER- UND HOLZPRODUKTE			
Mondi PLC	861	23,295	0.0
Oji Holdings Corp.	1,439	8,647	0.0
UPM-Kymmene Oyj	946	36,142	0.0
		<u>68,084</u>	<u>0.0</u>
		<u>25,175,578</u>	<u>1.9</u>
IMMOBILIEN			
IMMOBILIENAKTIVITÄTEN – DIVERSIFIZIERT			
Sun Hung Kai Properties Ltd.	2,312	36,106	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
REITS – DIVERSIFIZIERT			
Armada Hoffer Properties, Inc.	20,803	\$ 276,056	0.0%
Daiwa House REIT Investment Corp.	83	227,081	0.0
Essential Properties Realty Trust, Inc.	7,570	193,792	0.0
Fibra Uno Administracion SA de CV	113,680	133,268	0.0
Growthpoint Properties Ltd.	147,190	156,148	0.0
Hulic Reit, Inc.	117	186,949	0.0
ICADE	6,810	612,869	0.1
Merlin Properties Socimi SA	43,640	503,537	0.0
NIPPON REIT Investment Corp.	36	147,494	0.0
Nomura Real Estate Master Fund, Inc.	60	94,505	0.0
One Liberty Properties, Inc.	15,458	394,952	0.0
Stockland	323,763	1,163,084	0.2
		<u>4,089,735</u>	<u>0.3</u>
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
American Campus Communities, Inc.	25,640	1,209,183	0.1
American Tower Corp.	16,274	4,157,356	0.3
Iron Mountain, Inc.	43,413	1,890,202	0.2
Nippon Building Fund, Inc.	104	665,652	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.	66,825	2,447,132	0.2
Orix JREIT, Inc.	839	1,543,024	0.1
VICI Properties, Inc.	50,053	1,558,150	0.1
WP Carey, Inc.	6,040	455,718	0.0
		<u>13,926,417</u>	<u>1.0</u>
REITS – GESUNDHEITSWESSEN			
Arena REIT	35,740	94,503	0.0
Assura PLC	246,500	260,266	0.0
Medical Properties Trust, Inc.	36,730	777,574	0.1
New Senior Investment Group, Inc.	50,460	334,550	0.0
Physicians Realty Trust	41,620	754,571	0.1
		<u>2,221,464</u>	<u>0.2</u>
REITS – HOTELS UND RESORTS			
Apple Hospitality REIT, Inc.	49,770	789,850	0.1
REITS – INDUSTRIE			
Ascendas Real Estate Investment Trust	122,500	269,546	0.0
Centuria Industrial REIT	57,160	159,514	0.0
Dream Industrial Real Estate Investment Trust	33,640	382,890	0.0
ESR-REIT	436,193	130,281	0.0
GLP J-Reit	61	103,689	0.0
Industrial & Infrastructure Fund Investment Corp.	75	134,452	0.0
Industrial Logistics Properties Trust	31,090	779,115	0.1
LaSalle Logiport REIT	74	119,993	0.0
STAG Industrial, Inc.	19,810	707,415	0.1
		<u>2,786,895</u>	<u>0.2</u>
REITS – BÜROS			
Befimmo SA	7,660	332,539	0.1
Japan Prime Realty Investment Corp.	47	184,004	0.0
True North Commercial Real Estate Investment Trust	48,270	299,677	0.0
		<u>816,220</u>	<u>0.1</u>
IMMOBILIENENTWICKLUNG			
CK Asset Holdings Ltd.	4,258	28,969	0.0
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Daiwa House Industry Co., Ltd.	1,004	29,406	0.0
Hang Lung Properties Ltd.	3,590	9,275	0.0
Henderson Land Development Co., Ltd.	2,576	12,414	0.0
Nomura Real Estate Holdings, Inc.	205	5,396	0.0
Sino Land Co., Ltd.	5,848	9,328	0.0
Vonovia SE	9,352	587,196	0.0
		<u>653,015</u>	<u>0.0</u>
IMMOBILIEN-BETRIEBSGESELLSCHAFTEN			
Swire Properties Ltd.	2,075	6,256	0.0
Wharf Real Estate Investment Co., Ltd.	2,962	17,938	0.0
		<u>24,194</u>	<u>0.0</u>
REITS – WOHNRAUM			
Bluerock Residential Growth REIT, Inc.	41,633	404,256	0.0
Comforia Residential REIT, Inc.	31	95,398	0.0
Daiwa Securities Living Investments Corp.	62	62,940	0.0
Independence Realty Trust, Inc.	21,170	361,584	0.0
Killam Apartment Real Estate Investment Trust	12,160	190,747	0.0

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Sun Communities, Inc.	2,510	\$ 420,224	0.1%
UDR, Inc.	15,740	749,696	0.1
		<u>2,284,845</u>	<u>0.2</u>
REITS – EINZELHANDEL			
Aventus Group	42,420	95,489	0.0
Brixmor Property Group, Inc.	34,703	788,105	0.1
Kenedix Retail REIT Corp.	39	100,913	0.0
Klepierre SA	17,603	511,963	0.1
Mercialys SA	23,560	302,817	0.0
NewRiver REIT PLC	57,120	79,522	0.0
Shopping Centres Australasia Property Group	69,720	133,293	0.0
Simon Property Group, Inc.	6,090	782,504	0.1
SITE Centers Corp.	15,390	230,388	0.0
Vicinity Centres	293,391	356,226	0.0
		<u>3,381,220</u>	<u>0.3</u>
REITS – SPEZIALISIERT			
Digital Realty Trust, Inc.	1,560	236,434	0.0
Gaming and Leisure Properties, Inc.	17,535	812,922	0.1
MGM Growth Properties LLC - Class A	21,860	784,118	0.0
National Storage Affiliates Trust	4,510	207,911	0.0
		<u>2,041,385</u>	<u>0.1</u>
		<u>33,080,315</u>	<u>2.5</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGBETRIEBE			
Alliant Energy Corp.	453	25,889	0.0
American Electric Power Co., Inc.	900	77,400	0.0
AusNet Services Ltd.	647,905	876,570	0.1
CK Infrastructure Holdings Ltd.	1,175	7,479	0.0
CLP Holdings Ltd.	2,912	30,036	0.0
Duke Energy Corp.	1,394	139,707	0.0
Edison International	687	38,383	0.0
Endesa SA	43,577	1,256,760	0.1
Enel SpA	21,900	1,589,372	0.1
Evergy, Inc.	27,034	1,675,838	0.1
Eversource Energy	622	50,500	0.0
Fortis, Inc./Canada	827	37,734	0.0
Fortum Oyj	14,953	432,156	0.1
Hydro One Ltd.	583	14,835	0.0
Iberdrola SA	10,245	141,236	0.0
Mercury NZ Ltd.	1,208	5,723	0.0
NextEra Energy, Inc.	16,208	1,186,604	0.0
NRG Energy, Inc.	11,600	372,940	0.0
Pinnacle West Capital Corp.	204	17,254	0.0
Power Assets Holdings Ltd.	2,460	15,436	0.0
PPL Corp.	1,394	40,579	0.0
Red Electrica Corp. SA	32,048	641,709	0.1
Terna SPA	57,381	438,733	0.1
Xcel Energy, Inc.	975	69,108	0.0
		<u>9,181,981</u>	<u>0.7</u>
GASVERSORGBETRIEBE			
AltaGas Ltd.	15,670	311,052	0.0
Atmos Energy Corp.	232	23,007	0.0
Hong Kong & China Gas Co., Ltd.	18,913	33,289	0.0
Osaka Gas Co., Ltd.	665	12,745	0.0
Snam SpA	197,554	1,163,582	0.1
Tokyo Gas Co., Ltd.	667	13,236	0.0
UGI Corp.	24,682	1,136,606	0.1
		<u>2,693,517</u>	<u>0.2</u>
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
Uniper SE	20,852	766,145	0.1
MEHRFACH-VERSORGBETRIEBE			
AGL Energy Ltd.	61,527	392,256	0.0
Algonquin Power & Utilities Corp.	1,059	16,174	0.0
Ameren Corp.	12,448	1,048,122	0.1
Atco Ltd./Canada - Class I	9,150	329,629	0.0
CMS Energy Corp.	524	32,876	0.0
Consolidated Edison, Inc.	621	47,966	0.0
Dominion Energy, Inc.	10,215	777,770	0.1
DTE Energy Co.	351	48,434	0.0
National Grid PLC	6,295	83,904	0.0
Public Service Enterprise Group, Inc.	917	56,964	0.0
RWE AG	1,139	43,321	0.0

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
	Sempra Energy			8,452	\$ 1,145,161	0.1%	
	WEC Energy Group, Inc.			572	53,716	0.0	
					4,076,293	0.3	
					16,717,936	1.3	
					461,344,499	34.8	
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT							
FINANZINSTITUTE							
BANKWESEN							
	Alliance Data Systems Corp.....	4.75%	12/15/2024	USD	833	858,497	0.1
	Alliance Data Systems Corp.....	7.00%	01/15/2026		305	327,494	0.0
	Ally Financial, Inc., Series B(a).....	4.70%	05/15/2026		551	566,026	0.0
	Ally Financial, Inc., Series C(a).....	4.70%	05/15/2028		164	165,435	0.0
	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(a)	5.88%	05/24/2022	EUR	800	1,017,025	0.1
	Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(a).....	6.50%	03/05/2025	USD	200	217,160	0.0
	Banco Santander SA(a)	6.75%	04/25/2022	EUR	600	765,666	0.1
	CaixaBank SA(a)	5.88%	10/09/2027		600	836,326	0.1
	Citizens Financial Group, Inc., Series B(a)	6.00%	07/06/2023	USD	50	52,013	0.0
	Credit Suisse Group AG(a)	7.25%	09/12/2025		1,000	1,117,111	0.1
	Societe Generale SA(a)	8.00%	09/29/2025		791	928,989	0.0
	UniCredit SpA(a).....	9.25%	06/03/2022	EUR	230	302,277	0.0
					7,154,019	0.5	
MAKLER							
	NFP Corp.	7.00%	05/15/2025	USD	253	277,348	0.0
FINANZEN							
	CNG Holdings, Inc.	12.50%	06/15/2024		87	82,395	0.0
	Compass Group Diversified Holdings LLC.	5.25%	04/15/2029		451	465,144	0.1
	Curo Group Holdings Corp.....	8.25%	09/01/2025		184	188,553	0.0
	Enova International, Inc.	8.50%	09/01/2024		11	11,268	0.0
	Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025		175	181,943	0.0
	Hightower Holding LLC	6.75%	04/15/2029		1,495	1,516,966	0.1
	Lincoln Financing SARL.....	3.63%	04/01/2024	EUR	100	123,482	0.0
	Navient Corp.....	5.50%	01/25/2023	USD	219	229,722	0.0
	Navient Corp.....	6.50%	06/15/2022		507	530,855	0.1
	Navient Corp.....	7.25%	09/25/2023		12	13,166	0.0
	SLM Corp.....	5.13%	04/05/2022		20	20,431	0.0
					3,363,925	0.3	
VERSICHERUNGEN							
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.....	10.13%	08/01/2026		159	179,152	0.0
	Ardonagh Midco 2 PLC(b)	11.50%	01/15/2027		890	957,470	0.1
	AssuredPartners, Inc.....	5.63%	01/15/2029		1,042	1,038,996	0.1
					2,175,618	0.2	
SONSTIGE FINANZWERTE							
	Intrum AB	3.50%	07/15/2026	EUR	662	817,531	0.1
	Intrum AB	4.88%	08/15/2025		228	292,642	0.0
	Tempo Acquisition LLC/Tempo Acquisition Finance Corp.....	6.75%	06/01/2025	USD	516	525,190	0.0
					1,635,363	0.1	
REITS							
	Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026		1,582	1,661,109	0.1
	Diversified Healthcare Trust	4.75%	02/15/2028		1,380	1,333,183	0.1
	Diversified Healthcare Trust	6.75%	12/15/2021		50	50,080	0.0
	Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025		531	589,482	0.0
	Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029		645	660,451	0.1
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.63%	05/01/2024		1,308	1,407,868	0.1
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.75%	02/01/2027		68	75,518	0.0
	Park Intermediate Holdings LLC/ PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029		280	290,273	0.0
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.....	9.38%	04/01/2027		1,805	2,010,256	0.2
					8,078,220	0.6	
					22,684,493	1.7	
INDUSTRIE							
GRUNDSTOFFE							
	Alcoa Nederland Holding BV	6.13%	05/15/2028		1,550	1,689,500	0.1
	Ashland LLC	6.88%	05/15/2043		40	50,506	0.0
	Axalta Coating Systems LLC/Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV.....	4.75%	06/15/2027		219	227,760	0.0
	Berry Global, Inc.	4.50%	02/15/2026		286	292,880	0.0
	Berry Global, Inc.	5.13%	07/15/2023		5	5,034	0.0
	CF Industries, Inc.	3.45%	06/01/2023		500	520,199	0.0
	CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043		780	879,515	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	USD 25	\$ 29,207	0.0%
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.63%	03/01/2029	154	158,225	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.88%	03/01/2031	104	106,417	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	61	65,897	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025	434	508,023	0.0
FMG Resources (August 2006) Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	697	756,313	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	22	26,082	0.0
Graham Packaging Co., Inc.	7.13%	08/15/2028	159	169,495	0.0
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.	7.38%	12/15/2023	441	450,330	0.0
Hecla Mining Co.	7.25%	02/15/2028	642	705,443	0.1
Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV, Inc.	9.00%	07/01/2028	550	607,782	0.1
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	EUR 101	125,732	0.0
INEOS Quattro Finance 2 PLC	3.38%	01/15/2026	USD 205	205,110	0.0
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(b)	9.00%	01/15/2026	300	307,048	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./ Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	727	752,466	0.1
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	8.50%	08/01/2028	313	345,998	0.0
Mercer International, Inc.	5.13%	02/01/2029	550	567,335	0.0
Novelis Corp.	5.88%	09/30/2026	725	755,972	0.1
OCI NV	5.25%	11/01/2024	670	691,338	0.1
Peabody Energy Corp.(b)	8.50%	12/31/2024	5	3,162	0.0
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.	10.00%	12/31/2024	5	4,837	0.0
SPCM SA	4.88%	09/15/2025	980	1,004,093	0.1
United States Steel Corp.	6.25%	03/15/2026	309	315,400	0.0
Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030	962	983,101	0.1
WR Grace & Co.-Conn	4.88%	06/15/2027	228	240,162	0.0
				<u>13,550,362</u>	<u>1.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
ARD Finance SA(b)	5.00%	06/30/2027	EUR 225	280,184	0.0
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	08/15/2027	USD 710	714,437	0.1
Bombardier, Inc.	6.00%	10/15/2022	215	215,246	0.0
Bombardier, Inc.	6.13%	01/15/2023	626	657,432	0.1
Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024	419	430,649	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025	412	415,269	0.0
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027	23	23,345	0.0
Clean Harbors, Inc.	4.88%	07/15/2027	1,183	1,243,390	0.1
Cleaver-Brooks, Inc.	7.88%	03/01/2023	349	349,668	0.0
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026	12	12,661	0.0
EnerSys	4.38%	12/15/2027	260	269,802	0.0
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	761	775,874	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026	1,694	1,778,700	0.1
GFL Environmental, Inc.	5.13%	12/15/2026	710	746,136	0.1
GFL Environmental, Inc.	8.50%	05/01/2027	433	474,862	0.0
Granite US Holdings Corp.	11.00%	10/01/2027	690	770,646	0.1
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	5	5,092	0.0
RBS Global, Inc./Rexnord LLC.	4.88%	12/15/2025	485	495,386	0.0
Signature Aviation US Holdings, Inc.	4.00%	03/01/2028	710	712,535	0.1
SPX FLOW, Inc.	5.88%	08/15/2026	512	530,077	0.0
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026	205	219,155	0.0
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	5.25%	01/15/2029	197	208,282	0.0
Tervita Corp.	11.00%	12/01/2025	833	935,968	0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	826	842,093	0.1
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025	143	146,218	0.0
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	324	358,650	0.0
Vertical Holdco GmbH	7.63%	07/15/2028	227	244,934	0.0
				<u>13,856,691</u>	<u>1.0</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	687	729,076	0.1
Altice Financing SA.	7.50%	05/15/2026	986	1,026,574	0.1
AMC Networks, Inc.	4.25%	02/15/2029	1,051	1,043,592	0.1
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028	219	223,773	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.50%	05/01/2026	250	258,400	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.75%	02/15/2026	160	165,432	0.0
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	159	160,418	0.0
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	275	274,228	0.0
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	440	481,784	0.0
DISH DBS Corp.	5.00%	03/15/2023	61	63,452	0.0
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	90	95,814	0.0
DISH DBS Corp.	6.75%	06/01/2021	40	40,000	0.0
DISH DBS Corp.	7.38%	07/01/2028	725	778,057	0.1
DISH Network Corp.	3.38%	08/15/2026	473	489,455	0.0
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	240	244,597	0.0
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	89	92,077	0.0
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	468	500,146	0.0
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027	15	16,411	0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	83	87,339	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	USD 958	\$ 1,025,177	0.1%
Meredith Corp.....	6.88%	02/01/2026	1,759	1,837,848	0.2
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	200	175,464	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	128	122,192	0.0
Scripps Escrow II, Inc.....	5.38%	01/15/2031	236	236,700	0.0
Scripps Escrow, Inc.....	5.88%	07/15/2027	78	80,681	0.0
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	598	597,417	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.88%	03/15/2026	226	232,293	0.0
TEGNA, Inc.	4.63%	03/15/2028	475	485,335	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	1,152	1,177,263	0.1
Univision Communications, Inc.....	4.50%	05/01/2029	519	525,288	0.1
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	1,180	1,249,174	0.1
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	08/15/2026	975	1,011,641	0.1
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	206	209,638	0.0
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027	171	177,822	0.0
				<u>15,914,558</u>	<u>1.2</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	5.13%	07/15/2029	945	937,086	0.1
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026	421	437,816	0.0
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	200	218,041	0.0
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	644	668,111	0.1
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	137	139,673	0.0
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	649	701,617	0.1
DKT Finance ApS	9.38%	06/17/2023	1,150	1,175,854	0.1
Frontier Communications Holdings LLC	6.75%	05/01/2029	157	163,833	0.0
Hughes Satellite Systems Corp.....	6.63%	08/01/2026	450	499,761	0.0
Hughes Satellite Systems Corp.....	7.63%	06/15/2021	60	60,102	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	5.50%	08/01/2023	851	497,027	0.0
Level 3 Financing, Inc.	5.25%	03/15/2026	480	494,437	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series T	5.80%	03/15/2022	250	257,906	0.0
Lumen Technologies, Inc.	5.13%	12/15/2026	290	300,633	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series G	6.88%	01/15/2028	115	127,936	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series S	6.45%	06/15/2021	230	230,414	0.0
Sprint Corp.	7.25%	09/15/2021	5	5,086	0.0
T-Mobile USA, Inc.	5.38%	04/15/2027	500	530,234	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	3	3,930	0.0
Zayo Group Holdings, Inc.	6.13%	03/01/2028	729	741,992	0.1
				<u>8,191,489</u>	<u>0.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025	130	143,643	0.0
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029	877	953,678	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	624	677,144	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd.	10.50%	11/30/2025	504	556,222	0.0
Aston Martin Capital Holdings Ltd.(b)	15.00%	11/30/2026	686	752,268	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.....	6.25%	05/15/2026	1,157	1,235,433	0.1
Dana Financing Luxembourg SARL	5.75%	04/15/2025	5	5,163	0.0
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	61	64,929	0.0
Dana, Inc.	5.63%	06/15/2028	91	98,164	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028	751	792,830	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The).....	5.00%	07/15/2029	162	165,364	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The).....	5.25%	07/15/2031	147	150,240	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.63%	05/15/2025	EUR 100	124,261	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.38%	05/15/2029	USD 534	586,066	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	EUR 250	331,487	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	USD 603	614,185	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	536	583,810	0.0
Meritor, Inc.	4.50%	12/15/2028	826	830,130	0.1
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	200	212,802	0.0
PM General Purchaser LLC.	9.50%	10/01/2028	535	584,923	0.0
Real Hero Merger Sub 2, Inc.	6.25%	02/01/2029	255	263,366	0.0
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2026	775	769,339	0.1
Tenneco, Inc.	7.88%	01/15/2029	525	588,436	0.0
Titan International, Inc.	7.00%	04/30/2028	595	619,815	0.1
				<u>11,703,698</u>	<u>0.9</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	467	496,187	0.1
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	EUR 304	410,195	0.0
Carnival Corp.	9.88%	08/01/2027	USD 354	414,180	0.0
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023	812	928,547	0.1
Carnival PLC	1.00%	10/28/2029	EUR 138	138,115	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.38%	04/15/2027	USD 760	779,485	0.1
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.50%	05/01/2025	1,105	1,154,334	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	USD 206	\$ 225,655	0.0%
Mattel, Inc.	6.75%	12/31/2025	15	15,782	0.0
NCL Corp., Ltd.	3.63%	12/15/2024	1,200	1,147,710	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	236	248,095	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	738	846,855	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	1,329	1,538,317	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025	479	518,288	0.1
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	9.50%	08/01/2025	432	466,123	0.0
Silversea Cruise Finance Ltd.	7.25%	02/01/2025	44	45,537	0.0
Six Flags Entertainment Corp.	5.50%	04/15/2027	300	311,293	0.0
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	213	229,543	0.0
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	156	166,307	0.0
Viking Cruises Ltd.	5.88%	09/15/2027	1,663	1,610,478	0.1
Viking Cruises Ltd.	7.00%	02/15/2029	195	200,275	0.0
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	950	957,128	0.1
				<u>12,848,429</u>	<u>1.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	342	359,888	0.0
Bally's Corp.	6.75%	06/01/2027	446	474,182	0.0
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	17	17,607	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	499	491,182	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	460	485,402	0.0
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	600	632,668	0.1
CP Atlas Buyer, Inc.	7.00%	12/01/2028	245	253,341	0.0
Empire Communities Corp.	7.00%	12/15/2025	154	163,341	0.0
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025	432	456,610	0.0
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp.	6.50%	07/15/2025	158	170,281	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	3.63%	02/15/2032	513	503,011	0.1
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025	154	161,990	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.75%	05/01/2028	166	178,861	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/ Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029	375	379,006	0.0
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	33	34,733	0.0
K. Hovnanian Enterprises, Inc.	10.00%	07/15/2022	13	13,081	0.0
KB Home	4.80%	11/15/2029	65	69,849	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	164	174,399	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC	6.50%	09/15/2026	1,001	1,042,872	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	410	409,084	0.0
Scientific Games International, Inc.	5.00%	10/15/2025	980	1,009,677	0.1
Scientific Games International, Inc.	7.00%	05/15/2028	25	27,043	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	238	238,372	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	04/01/2029	484	483,377	0.0
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/ Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp.	5.88%	05/15/2025	24	23,617	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	129	143,440	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.88%	04/15/2023	50	53,000	0.0
Travel + Leisure Co.	6.00%	04/01/2027	651	720,233	0.1
Victors Merger Corp.	6.38%	05/15/2029	816	810,092	0.1
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025	470	501,036	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	137	142,713	0.0
				<u>10,623,988</u>	<u>0.8</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
1011778 BC ULC/New Red Finance, Inc.	5.75%	04/15/2025	297	314,711	0.0
IRB Holding Corp.	6.75%	02/15/2026	379	392,265	0.1
				<u>706,976</u>	<u>0.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(b)	7.75%	04/01/2027	276	286,427	0.0
Burlington Coat Factory Warehouse Corp.	6.25%	04/15/2025	71	76,616	0.0
Dufry One BV	2.50%	10/15/2024	EUR 833	1,003,834	0.1
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	USD 132	136,517	0.0
Foundation Building Materials, Inc.	6.00%	03/01/2029	132	129,422	0.0
L Brands, Inc.	5.25%	02/01/2028	364	395,578	0.0
L Brands, Inc.	6.63%	10/01/2030	178	203,497	0.0
L Brands, Inc.	6.75%	07/01/2036	347	413,604	0.0
L Brands, Inc.	7.50%	06/15/2029	117	135,035	0.0
L Brands, Inc.	9.38%	07/01/2025	62	78,935	0.0
LBM Acquisition LLC	6.25%	01/15/2029	174	177,906	0.0
Magic Mergeco, Inc.	7.88%	05/01/2029	793	808,678	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	4.75%	09/15/2029	460	480,422	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	5.63%	05/01/2027	4	4,223	0.0
NMG Holding Co., Inc./Neiman Marcus Group LLC	7.13%	04/01/2026	328	346,416	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Penske Automotive Group, Inc.	5.50%	05/15/2026	USD 1,087	\$ 1,118,895	0.1%
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	361	373,936	0.0
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	7.75%	02/15/2029	816	898,696	0.1
Rite Aid Corp.	7.50%	07/01/2025	733	761,387	0.1
Sonic Automotive, Inc.	6.13%	03/15/2027	26	27,295	0.0
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	1,021	1,064,497	0.1
SRS Distribution, Inc.	6.13%	07/01/2029	157	160,140	0.0
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	154	159,769	0.0
Staples, Inc.	10.75%	04/15/2027	827	846,514	0.1
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024	70	76,949	0.0
White Cap Buyer LLC.	6.88%	10/15/2028	843	889,018	0.1
White Cap Parent LLC(b)	8.25%	03/15/2026	175	180,712	0.0
William Carter Co. (The)	5.50%	05/15/2025	248	261,690	0.0
				<u>11,496,608</u>	<u>0.9</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC.	4.63%	08/01/2029	691	678,262	0.1
AdaptHealth LLC.	6.13%	08/01/2028	146	153,791	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC.	4.63%	01/15/2027	347	359,185	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC.	4.88%	02/15/2030	240	250,113	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC.	5.75%	03/15/2025	8	8,215	0.0
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	211	226,440	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	4.88%	06/01/2028	728	733,199	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	6.13%	04/15/2025	44	44,939	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	30	29,330	0.0
Catalent Pharma Solutions, Inc.	5.00%	07/15/2027	450	468,237	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	40	42,700	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	4.75%	02/15/2031	231	226,738	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/01/2028	308	295,407	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.	6.88%	04/15/2029	1,706	1,752,350	0.1
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	69	67,752	0.0
Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc.	6.00%	06/30/2028	188	129,993	0.0
Endo Dac/Endo Finance LLC/Endo Finco, Inc.	9.50%	07/31/2027	461	469,067	0.0
Endo Luxembourg Finance Co. I Sarl/Endo US, Inc.	6.13%	04/01/2029	122	120,163	0.0
Global Medical Response, Inc.	6.50%	10/01/2025	795	818,391	0.1
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	5.00%	12/31/2026	607	617,292	0.1
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	7.00%	12/31/2027	777	790,019	0.1
Lamb Weston Holdings, Inc.	4.63%	11/01/2024	14	14,492	0.0
Lamb Weston Holdings, Inc.	4.88%	11/01/2026	13	13,456	0.0
Legacy LifePoint Health LLC.	4.38%	02/15/2027	967	964,562	0.1
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC(c) ...	5.50%	04/15/2025	22	13,703	0.0
ModivCare, Inc.	5.88%	11/15/2025	97	102,356	0.0
Organon Finance 1 LLC.	5.13%	04/30/2031	431	443,072	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	64	68,353	0.0
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	27	28,508	0.0
RP Escrow Issuer LLC.	5.25%	12/15/2025	203	210,107	0.0
Spectrum Brands, Inc.	3.88%	03/15/2031	990	965,049	0.1
Tenet Healthcare Corp.	4.88%	01/01/2026	577	595,828	0.1
Tenet Healthcare Corp.	5.13%	05/01/2025	573	581,045	0.1
Tenet Healthcare Corp.	6.25%	02/01/2027	425	443,823	0.0
Triton Water Holdings, Inc.	6.25%	04/01/2029	352	352,928	0.0
US Acute Care Solutions LLC.	6.38%	03/01/2026	96	99,351	0.0
US Foods, Inc.	4.75%	02/15/2029	1,094	1,090,539	0.1
US Renal Care, Inc.	10.63%	07/15/2027	1,228	1,282,796	0.1
Vizient, Inc.	6.25%	05/15/2027	21	22,191	0.0
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	132	137,500	0.0
				<u>15,711,242</u>	<u>1.2</u>
ENERGIE					
Antero Resources Corp.	5.00%	03/01/2025	430	440,734	0.0
Antero Resources Corp.	8.38%	07/15/2026	327	368,865	0.0
Apache Corp.	4.63%	11/15/2025	25	26,545	0.0
Apache Corp.	4.88%	11/15/2027	46	48,295	0.0
Apache Corp.	7.75%	12/15/2029	17	19,910	0.0
Berry Petroleum Co. LLC.	7.00%	02/15/2026	279	276,037	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	153	159,598	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	234	253,098	0.0
Bonanza Creek Energy, Inc.	7.50%	04/30/2026	3	3,370	0.0
Callon Petroleum, Co.	6.25%	04/15/2023	15	14,207	0.0
Callon Petroleum, Co.	8.25%	07/15/2025	10	9,474	0.0
Callon Petroleum, Co.	9.00%	04/01/2025	887	929,647	0.1
Cheniere Energy Partners LP.	4.50%	10/01/2029	176	186,433	0.0
Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024	69	70,731	0.0
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	251	258,172	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	USD 888	\$ 923,182	0.1%
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	379	404,098	0.0
Comstock Resources, Inc.	6.75%	03/01/2029	57	59,475	0.0
Comstock Resources, Inc.	7.50%	05/15/2025	19	19,703	0.0
Comstock Resources, Inc.	9.75%	08/15/2026	1,080	1,171,380	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	697	697,342	0.1
EnLink Midstream LLC.	5.63%	01/15/2028	597	621,513	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024	37	38,397	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045	467	393,465	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047	321	281,254	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	61	54,514	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024	18	18,021	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026	75	74,020	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025	493	496,742	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	1,887	1,897,092	0.2
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	220	237,643	0.0
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	72	76,286	0.0
Gulfport Energy Corp.	8.00%	05/17/2026	610	677,352	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	157	161,110	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	158	163,331	0.0
Independence Energy Finance LLC.	7.25%	05/01/2026	564	571,680	0.1
Indigo Natural Resources LLC	5.38%	02/01/2029	407	409,087	0.0
Ithaca Energy North Sea PLC	9.38%	07/15/2024	1,930	1,948,141	0.2
Moss Creek Resources Holdings, Inc.	7.50%	01/15/2026	543	481,727	0.0
Moss Creek Resources Holdings, Inc.	10.50%	05/15/2027	330	312,657	0.0
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	152	135,245	0.0
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028	679	576,948	0.1
Nabors Industries, Inc.	5.75%	02/01/2025	600	497,751	0.1
Neptune Energy Bondco PLC	6.63%	05/15/2025	360	367,835	0.0
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	924	938,285	0.1
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	1,079	1,122,083	0.1
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023	531	517,284	0.1
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023	408	410,695	0.0
Occidental Petroleum Corp.	2.90%	08/15/2024	232	231,738	0.0
Occidental Petroleum Corp.	3.40%	04/15/2026	37	36,206	0.0
Occidental Petroleum Corp.	3.50%	06/15/2025	188	188,232	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.50%	12/01/2025	77	82,925	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	130	140,819	0.0
Occidental Petroleum Corp.	6.13%	01/01/2031	180	199,614	0.0
Occidental Petroleum Corp.	6.95%	07/01/2024	70	77,809	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.00%	07/15/2025	205	240,635	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.50%	07/15/2027	103	125,344	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	103	132,067	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	9.25%	05/15/2025	900	926,080	0.1
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	22	22,927	0.0
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	51	52,167	0.0
Range Resources Corp.	8.25%	01/15/2029	218	243,078	0.0
Renewable Energy Group, Inc.	5.88%	06/01/2028	110	114,436	0.0
SM Energy Co.	5.63%	06/01/2025	703	672,694	0.1
SM Energy Co.	6.75%	09/15/2026	15	14,952	0.0
Southwestern Energy Co.	8.38%	09/15/2028	229	253,683	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028	40	42,118	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	6.00%	04/15/2027	3	3,132	0.0
Talos Production, Inc.	12.00%	01/15/2026	815	831,300	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.	7.75%	10/15/2024	19	19,492	0.0
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	49	47,839	0.0
Transocean Sentry Ltd.	5.38%	05/15/2023	747	716,365	0.1
Transocean, Inc.	7.25%	11/01/2025	33	26,303	0.0
Transocean, Inc.	7.50%	01/15/2026	19	14,913	0.0
Transocean, Inc.	8.00%	02/01/2027	328	248,851	0.0
Transocean, Inc.	11.50%	01/30/2027	334	332,115	0.0
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	137	142,398	0.0
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022	156	159,555	0.0
Western Midstream Operating LP	4.35%	02/01/2025	320	334,897	0.0
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	207	219,604	0.0
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	167	179,499	0.0
Western Midstream Operating LP	5.30%	02/01/2030	278	306,447	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	104	107,742	0.0
				27,308,430	2.0
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	202	213,351	0.0
Interface, Inc.	5.50%	12/01/2028	130	135,981	0.0
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025	637	650,692	0.1
Laureate Education, Inc.	8.25%	05/01/2025	16	16,660	0.0
				1,016,684	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
DIENTSTLEISTUNGEN					
ADT Security Corp. (The)	4.88%	07/15/2032	USD 165	\$ 170,169	0.0%
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	1,166	1,238,053	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027	1,062	1,170,967	0.1
ANGI Group LLC	3.88%	08/15/2028	1,227	1,204,297	0.1
Aptim Corp.	7.75%	06/15/2025	295	256,830	0.0
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	79	83,660	0.0
APX Group, Inc.	7.63%	09/01/2023	85	87,478	0.0
APX Group, Inc.	7.88%	12/01/2022	373	374,709	0.0
Carriage Services, Inc.	6.63%	06/01/2026	35	36,739	0.0
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	421	447,166	0.0
Garda World Security Corp.	6.00%	06/01/2029	1,299	1,287,324	0.1
Gartner, Inc.	4.50%	07/01/2028	283	297,628	0.0
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028	275	279,011	0.0
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027	163	167,740	0.0
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	1,377	1,369,956	0.1
Nielsen Co. Luxembourg SARL (The)	5.00%	02/01/2025	1,276	1,310,584	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	1,002	1,035,391	0.1
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025	12	12,361	0.0
Sabre GBLBL, Inc.	9.25%	04/15/2025	364	426,141	0.0
Service Corp. International/US	3.38%	08/15/2030	597	579,644	0.1
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	205	220,867	0.0
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	EUR 508	638,096	0.1
Verscend Escrow Corp.	9.75%	08/15/2026	USD 1,188	1,260,045	0.1
				<u>13,954,856</u>	<u>1.0</u>
TECHNOLOGIE					
Ahead DB Holdings LLC	6.63%	05/01/2028	424	429,785	0.0
Austin BidCo, Inc.	7.13%	12/15/2028	104	103,941	0.0
Avaya, Inc.	6.13%	09/15/2028	1,402	1,487,278	0.1
Banff Merger Sub, Inc.	9.75%	09/01/2026	1,691	1,790,921	0.1
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	204	218,610	0.0
Cablevision Lightpath LLC	5.63%	09/15/2028	560	564,677	0.1
CommScope, Inc.	5.50%	03/01/2024	506	521,348	0.1
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	31	32,597	0.0
Microchip Technology, Inc.	4.25%	09/01/2025	341	357,892	0.0
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	54	56,857	0.0
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	908	985,894	0.1
NCR Corp.	8.13%	04/15/2025	58	63,194	0.0
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	199	204,462	0.0
Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028	403	439,032	0.0
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	64	66,408	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	116	116,961	0.0
Solera LLC/Solera Finance, Inc.	10.50%	03/01/2024	60	61,599	0.0
TTM Technologies, Inc.	4.00%	03/01/2029	502	497,464	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	1,749	1,810,965	0.1
				<u>9,809,885</u>	<u>0.7</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	563	594,687	0.1
American Airlines, Inc./AAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	494	528,558	0.0
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	271	287,692	0.0
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	535	607,112	0.1
United Airlines, Inc.	4.63%	04/15/2029	162	167,774	0.0
				<u>2,185,823</u>	<u>0.2</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	860	917,248	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	364	378,550	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	488	513,222	0.0
Modulaire Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023	1,945	1,982,020	0.2
United Rentals North America, Inc.	5.50%	05/15/2027	18	19,037	0.0
United Rentals North America, Inc.	5.88%	09/15/2026	69	71,783	0.0
				<u>3,881,860</u>	<u>0.3</u>
				<u>172,761,579</u>	<u>13.0</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Calpine Corp.	5.25%	06/01/2026	510	524,862	0.1
NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027	3	3,113	0.0
NRG Energy, Inc.	7.25%	05/15/2026	525	545,023	0.1
Talen Energy Supply LLC	6.50%	06/01/2025	205	172,603	0.0
Talen Energy Supply LLC	7.25%	05/15/2027	371	379,208	0.0
Talen Energy Supply LLC	10.50%	01/15/2026	322	293,020	0.0
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	48	49,891	0.0
				<u>1,967,720</u>	<u>0.2</u>

		Zinssatz	Datum		Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE VERSORGBETRIEBE							
	Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	USD	183	\$ 191,698	0.0%
						2,159,418	0.2
						197,605,490	14.9
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE							
KOLUMBIEN							
	Colombian TES, Series B	6.25%	11/26/2025	COP	6,765,500	1,877,043	0.1
ÄGYPTEN							
	Egypt Treasury Bills, Series 364D	0.00%	06/29/2021	EGP	28,125	1,777,478	0.1
INDONESIEN							
	Indonesia Treasury Bond, Series FR70	8.38%	03/15/2024	IDR	2,113,000	160,712	0.0
	Indonesia Treasury Bond, Series FR71	9.00%	03/15/2029		31,042,000	2,510,958	0.2
						2,671,670	0.2
MEXIKO							
	Mexican Bonos, Series M	6.50%	06/10/2021	MXN	2,100	105,496	0.0
	Mexican Bonos, Series M	8.00%	09/05/2024		132,187	7,074,163	0.5
	Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047		9,444	493,851	0.1
	Mexican Bonos, Series M 20	7.50%	06/03/2027		31,868	1,691,957	0.1
	Mexican Bonos, Series M 20	10.00%	12/05/2024		37,077	2,107,547	0.2
						11,473,014	0.9
RUSSLAND							
	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6209	7.60%	07/20/2022	RUB	1,155	16,064	0.0
	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6212	7.05%	01/19/2028		20,100	278,452	0.0
	Russian Federal Bond - OFZ, Series 6215	7.00%	08/16/2023		132,181	1,839,125	0.2
						2,133,641	0.2
VEREINIGTE STAATEN							
	U.S. Treasury Bonds	1.25%	05/15/2050	USD	2,333	1,813,752	0.1
	U.S. Treasury Bonds	6.25%	05/15/2030		250	350,859	0.0
	U.S. Treasury Notes(d)	0.63%	08/15/2030		22,438	20,663,719	1.6
	U.S. Treasury Notes(d)	0.88%	11/15/2030		21,912	20,590,433	1.6
	U.S. Treasury Notes	1.63%	08/15/2029		31,987	32,486,695	2.5
	U.S. Treasury Notes	2.13%	03/31/2024		3,000	3,157,032	0.2
	U.S. Treasury Notes	2.25%	02/15/2027		1,400	1,499,313	0.1
	U.S. Treasury Notes	2.63%	02/15/2029		7,402	8,087,841	0.6
	U.S. Treasury Notes	3.13%	11/15/2028		920	1,037,875	0.1
						89,687,519	6.8
						109,620,365	8.3
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE							
ANGOLA							
	Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029		1,936	1,968,428	0.2
	Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049		1,856	1,888,828	0.1
	Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048		202	209,045	0.0
	Angolan Government International Bond	9.50%	11/12/2025		400	439,450	0.0
						4,505,751	0.3
ARGENTINIEN							
	Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2030		3,994	1,469,748	0.1
	Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2035		8,186	2,692,626	0.2
	Argentine Republic Government International Bond	0.13%	01/09/2038		26	10,396	0.0
	Argentine Republic Government International Bond	0.13%	07/09/2041		153	56,860	0.0
	Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029		678	263,118	0.0
						4,492,748	0.3
BAHRAIN							
	Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031		490	491,929	0.0
	Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029		400	437,200	0.0
	Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028		4,347	4,861,848	0.4
	CBB International Sukuk Programme Co. WLL	6.25%	11/14/2024		588	646,543	0.1
						6,437,520	0.5
COSTA RICA							
	Costa Rica Government International Bond	4.38%	04/30/2025		400	416,325	0.1
	Costa Rica Government International Bond	6.13%	02/19/2031		2,376	2,531,628	0.2
	Costa Rica Government International Bond	7.16%	03/12/2045		249	261,964	0.0
						3,209,917	0.3
DOMINIKANISCHE REPUBLIK							
	Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030		954	977,433	0.1
	Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060		275	270,531	0.0
	Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027		1,503	1,696,042	0.1
	Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028		150	170,578	0.0
	Dominican Republic International Bond	6.40%	06/05/2049		2,696	2,887,753	0.2
	Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026		1,794	2,085,861	0.2

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
	Dominican Republic International Bond	7.45%	04/30/2044	USD 200	\$ 240,537	0.0%
					<u>8,328,735</u>	<u>0.6</u>
ECUADOR	Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	261	146,796	0.0
	Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2030	1,118	967,195	0.1
	Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2035	2,727	1,905,230	0.1
	Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	1,172	<u>741,615</u>	<u>0.1</u>
					<u>3,760,836</u>	<u>0.3</u>
ÄGYPTEN	Egypt Government International Bond	7.60%	03/01/2029	1,100	1,224,300	0.1
	Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	613	663,687	0.1
	Egypt Government International Bond	8.15%	11/20/2059	280	284,952	0.0
	Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	1,056	1,119,888	0.1
	Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	3,160	3,397,593	0.2
	Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	1,210	<u>1,328,202</u>	<u>0.1</u>
					<u>8,018,622</u>	<u>0.6</u>
EL SALVADOR	El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	24	23,250	0.0
	El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	2,786	2,726,797	0.2
	El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	1,358	1,278,217	0.1
	El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	15	15,038	0.0
	El Salvador Government International Bond	7.75%	01/24/2023	11	11,206	0.0
	El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	190	<u>203,063</u>	<u>0.0</u>
					<u>4,257,571</u>	<u>0.3</u>
GABUN	Gabon Government International Bond	6.38%	12/12/2024	397	418,704	0.0
	Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	2,216	<u>2,211,568</u>	<u>0.2</u>
					<u>2,630,272</u>	<u>0.2</u>
GHANA	Ghana Government International Bond	6.38%	02/11/2027	2,809	2,827,083	0.2
	Ghana Government International Bond	7.75%	04/07/2029	536	554,090	0.1
	Ghana Government International Bond	8.13%	01/18/2026	466	501,183	0.0
	Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	710	727,439	0.1
	Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	201	195,950	0.0
	Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051	527	524,464	0.0
	Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030	370	<u>469,160</u>	<u>0.0</u>
					<u>5,799,369</u>	<u>0.4</u>
GUATEMALA	Guatemala Government Bond	4.90%	06/01/2030	1,198	<u>1,339,738</u>	<u>0.1</u>
HONDURAS	Honduras Government International Bond	5.63%	06/24/2030	183	192,070	0.0
	Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	2,936	<u>3,214,553</u>	<u>0.3</u>
					<u>3,406,623</u>	<u>0.3</u>
IRAK	Iraq International Bond	5.80%	01/15/2028	236	227,213	0.0
	Iraq International Bond	6.75%	03/09/2023	200	<u>204,975</u>	<u>0.0</u>
					<u>432,188</u>	<u>0.0</u>
ELFENBEINKÜSTE	Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR 473	583,758	0.0
	Ivory Coast Government International Bond	5.38%	07/23/2024	USD 3,167	3,414,026	0.3
	Ivory Coast Government International Bond	5.88%	10/17/2031	EUR 645	855,270	0.1
	Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	USD 2,315	2,463,015	0.2
	Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	518	<u>576,048</u>	<u>0.0</u>
					<u>7,892,117</u>	<u>0.6</u>
JAMAICA	Jamaica Government International Bond	6.75%	04/28/2028	1,253	1,483,082	0.1
	Jamaica Government International Bond	7.63%	07/09/2025	200	232,788	0.0
	Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	749	<u>1,037,131</u>	<u>0.1</u>
					<u>2,753,001</u>	<u>0.2</u>
KENIA	Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024	1,694	1,880,658	0.2
	Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	257	282,828	0.0
	Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	1,783	<u>1,977,793</u>	<u>0.1</u>
					<u>4,141,279</u>	<u>0.3</u>
LIBANON	Lebanon Government International Bond(c)	6.65%	04/22/2024	25	3,278	0.0
	Lebanon Government International Bond(c)	6.85%	03/23/2027	69	9,005	0.0
	Lebanon Government International Bond, Series G(c)	1.00%	11/27/2026	817	<u>107,639</u>	<u>0.0</u>
					<u>119,922</u>	<u>0.0</u>

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MONGOLEI						
	Mongolia Government International Bond	5.13%	12/05/2022	USD 1,126	\$ 1,170,196	0.1%
NAMIBIA						
	Namibia International Bonds	5.25%	10/29/2025	200	213,288	0.0
NIGERIA						
	Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	763	811,546	0.1
	Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	500	532,281	0.0
	Nigeria Government International Bond	7.63%	11/21/2025	650	738,684	0.1
	Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	1,568	1,580,054	0.1
	Nigeria Government International Bond	8.75%	01/21/2031	1,940	2,214,389	0.2
					5,876,954	0.5
OMAN						
	Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	828	865,415	0.1
	Oman Government International Bond	5.38%	03/08/2027	1,340	1,390,920	0.1
	Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	878	928,485	0.1
					3,184,820	0.3
PAKISTAN						
	Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	225	235,167	0.0
SENEGAL						
	Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 150	191,355	0.0
	Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	USD 1,417	1,496,086	0.1
	Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	3,207	3,263,724	0.3
					4,951,165	0.4
SÜDAFRIKA						
	Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029	2,392	2,530,736	0.2
	Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	1,907	1,918,680	0.1
					4,449,416	0.3
UKRAINE						
	Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	3,778	4,008,930	0.3
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2022	390	410,548	0.0
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2023	700	756,481	0.1
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2024	100	109,988	0.0
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	310	343,693	0.0
	Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	2,352	2,613,366	0.3
	Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2028	352	421,256	0.0
					8,664,262	0.7
VENEZUELA						
	Venezuela Government International Bond(c)	9.00%	05/07/2023	4	350	0.0
	Venezuela Government International Bond(c)	9.25%	09/15/2027	219	21,900	0.0
					22,250	0.0
					100,293,727	7.6
VORZUGSAKTIE						
FINANZINSTITUTE						
REITS – DIVERSIFIZIERT						
	Armada Hoffer Properties, Inc. Series A	6.75%		124,440	3,440,766	0.3
	Colony Capital, Inc. Series G	7.50%		37,877	954,500	0.1
	Colony Capital, Inc. Series H	7.13%		75,081	1,873,271	0.1
	Colony Capital, Inc. Series I	7.15%		74,401	1,856,305	0.1
	Colony Capital, Inc. Series J	7.13%		96,084	2,397,296	0.2
	Gladstone Commercial Corp. Series D	7.00%		3,437	86,200	0.0
	Gladstone Commercial Corp. Series E	6.63%		44,750	1,170,212	0.1
	Global Net Lease, Inc. Series A	7.25%		72,050	1,900,679	0.1
	Global Net Lease, Inc. Series B	6.88%		36,703	987,586	0.1
	PS Business Parks, Inc. Series X	5.25%		17,650	470,549	0.0
	PS Business Parks, Inc. Series Y	5.20%		42,613	1,133,506	0.1
	PS Business Parks, Inc. Series Z	4.88%		73,300	1,986,430	0.2
	Vornado Realty Trust Series L	5.40%		24,093	614,372	0.0
					18,871,672	1.4
REITS – GESUNDHEITSWESSEN						
	Global Medical REIT, Inc. Series A	7.50%		16,474	437,385	0.0
REITS – HOTELS UND RESORTS						
	DiamondRock Hospitality Co.	8.25%		105,507	3,064,978	0.2
	Hersha Hospitality Trust Series C	6.88%		37,190	909,295	0.1
	Hersha Hospitality Trust Series D	6.50%		29,342	693,645	0.1
	Hersha Hospitality Trust Series E	6.50%		14,874	353,406	0.0
	Pebblebrook Hotel Trust Series C(a)	6.50%		28,825	735,902	0.1
	Pebblebrook Hotel Trust Series D	6.38%		80,196	2,032,969	0.1
	Pebblebrook Hotel Trust Series E	6.38%		40,482	1,028,648	0.1
	Pebblebrook Hotel Trust Series F	6.30%		4,053	104,041	0.0
	Summit Hotel Properties, Inc. Series D	6.45%		18,109	461,598	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Summit Hotel Properties, Inc. Series E	6.25%		64,647	\$ 1,723,489	0.1%
Sunstone Hotel Investors, Inc. Series E	6.95%		26,808	677,438	0.1
Sunstone Hotel Investors, Inc. Series F	6.45%		47,398	1,208,649	0.1
				<u>12,994,058</u>	<u>1.0</u>
REITS – INDUSTRIE					
Monmouth Real Estate Investment Corp. Series C	6.13%		109,396	2,754,591	0.2
Plymouth Industrial REIT, Inc. Series A	7.50%		6,338	167,741	0.0
Rexford Industrial Realty, Inc. Series A	5.88%		53,947	1,370,793	0.1
Rexford Industrial Realty, Inc. Series B	5.88%		58,870	1,554,168	0.1
Rexford Industrial Realty, Inc. Series C	5.63%		29,222	810,326	0.1
				<u>6,657,619</u>	<u>0.5</u>
REITS – BÜROS					
City Office REIT, Inc. Series A	6.63%		66,510	1,703,986	0.1
SL Green Realty Corp. Series I	6.50%		12,450	322,330	0.0
Vornado Realty Trust Series M	5.25%		124,358	3,293,000	0.3
Vornado Realty Trust Series N	5.25%		7,072	188,257	0.0
				<u>5,507,573</u>	<u>0.4</u>
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Gulfport Energy Corp.	0.00%		56	266,000	0.0
IMMOBILIENENTWICKLUNG					
American Finance Trust, Inc. Series C	7.38%		117,300	3,015,783	0.2
Pebblebrook Hotel Trust Series G	6.38%		80,481	2,079,629	0.2
Sunstone Hotel Investors, Inc. Series H	6.13%		68,575	1,833,696	0.1
				<u>6,929,108</u>	<u>0.5</u>
IMMOBILIEN-BETRIEBSGESELLSCHAFTEN					
Brookfield Property Partners LP Series A	5.75%		8,864	217,080	0.0
Brookfield Property Partners LP Series A2	6.38%		34,597	918,550	0.1
				<u>1,135,630</u>	<u>0.1</u>
REITS – WOHNRAUM					
American Homes 4 Rent Series D	6.50%		110,764	2,801,222	0.2
American Homes 4 Rent Series E	6.35%		25,387	643,814	0.1
American Homes 4 Rent Series F	5.88%		40,244	1,050,771	0.1
American Homes 4 Rent Series G	5.88%		48,129	1,274,456	0.1
American Homes 4 Rent Series H	6.25%		13,501	371,547	0.0
Bluerock Residential Growth REIT, Inc. Series C	7.63%		24,474	623,952	0.0
Bluerock Residential Growth REIT, Inc. Series D	7.13%		36,139	914,317	0.1
UMH Properties, Inc. Series C	6.75%		12,275	317,800	0.0
UMH Properties, Inc. Series D	6.38%		155,645	4,032,762	0.3
				<u>12,030,641</u>	<u>0.9</u>
REITS – EINZELHANDEL					
American Finance Trust, Inc. Series A	7.50%		12,673	328,611	0.0
Brookfield Property REIT, Inc. Series A	6.38%		82,506	2,087,402	0.1
Cedar Realty Trust, Inc. Series C	6.50%		45,026	1,134,655	0.1
Federal Realty Investment Trust Series C	5.00%		12,671	331,853	0.0
Kimco Realty Corp. Series L	5.13%		191	5,035	0.0
Kimco Realty Corp. Series M	5.25%		325	8,518	0.0
National Retail Properties, Inc. Series F	5.20%		12,168	309,797	0.0
Saul Centers, Inc. Series D	6.13%		33,900	897,333	0.1
Saul Centers, Inc. Series E	6.00%		56,093	1,493,196	0.1
Seritage Growth Properties Series A	7.00%		38,147	923,539	0.1
SITE Centers Corp. Series A	6.38%		114,056	2,944,926	0.2
Spirit Realty Capital, Inc. Series A	6.00%		79,684	2,157,046	0.2
Urstadt Biddle Properties, Inc. Series H	6.25%		80,452	2,123,128	0.2
Urstadt Biddle Properties, Inc. Series K	5.88%		34,529	890,848	0.1
				<u>15,635,887</u>	<u>1.2</u>
REITS – SPEZIALISIERT					
Digital Realty Trust, Inc. Series K	5.85%		39,392	1,115,188	0.1
Digital Realty Trust, Inc. Series L	5.20%		148,716	4,128,356	0.3
EPR Properties Series G	5.75%		18,353	472,957	0.0
National Storage Affiliates Trust Series A	6.00%		121,499	3,250,098	0.3
Public Storage Series G	5.05%		16,257	429,835	0.0
Public Storage Series H	5.60%		12,649	354,046	0.0
Public Storage Series K	4.75%		34,642	960,276	0.1
Public Storage Series L	4.63%		4,600	124,062	0.0
Public Storage Series M	4.13%		80,348	2,089,048	0.2
QTS Realty Trust, Inc. Series A	7.13%		97,229	2,649,490	0.2
				<u>15,573,356</u>	<u>1.2</u>
				<u>96,038,929</u>	<u>7.2</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
INDUSTRIE						
REITS – WOHNRAUM						
Centerspace Series C	6.63%		29,361	\$ 777,480	0.1%	
				96,816,409	7.3	
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	USD	649	917,664	0.1
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple						
Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025		511	579,123	0.0
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025		600	687,814	0.1
Bank of America Corp., Series DD(a)	6.30%	03/10/2026		144	166,911	0.0
Bank of America Corp., Series JJ(a)	5.13%	06/20/2024		1,274	1,360,736	0.1
Bank of America Corp., Series X(a)	6.25%	09/05/2024		140	155,398	0.0
Bank of America Corp., Series Z(a)	6.50%	10/23/2024		445	506,053	0.0
Barclays PLC(a)	7.88%	03/15/2022		207	216,169	0.0
BNP Paribas SA(a)	6.75%	03/14/2022		200	207,281	0.0
Citigroup, Inc.(a)	3.88%	02/18/2026		666	671,187	0.1
Citigroup, Inc.(a)	5.95%	01/30/2023		67	70,520	0.0
Citigroup, Inc., Series T(a)	6.25%	08/15/2026		99	115,149	0.0
Citigroup, Inc., Series U(a)	5.00%	09/12/2024		945	988,176	0.1
Citigroup, Inc., Series V(a)	4.70%	01/30/2025		143	146,872	0.0
Citigroup, Inc., Series W(a)	4.00%	12/10/2025		665	678,107	0.1
Credit Agricole SA(a)	8.13%	12/23/2025		1,045	1,267,392	0.1
DNB Bank ASA(a)	6.50%	03/26/2022		1,085	1,127,752	0.1
Erste Group Bank AG(a)	6.50%	04/15/2024	EUR	400	547,533	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(a)	5.30%	11/10/2026	USD	9	9,925	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(a)	5.00%	11/10/2022		792	796,371	0.1
HSBC Holdings PLC(a)	6.00%	05/22/2027		1,078	1,188,404	0.1
HSBC Holdings PLC(a)	6.38%	03/30/2025		980	1,085,350	0.1
ING Groep NV(a)	5.75%	11/16/2026		420	462,409	0.0
ING Groep NV(a)	6.75%	04/16/2024		200	219,990	0.0
ING Groep NV(a)	6.88%	04/16/2022		303	315,652	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series V(a) (e)	3.52%	07/01/2021		17	16,934	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series X(a)	6.10%	10/01/2024		750	813,935	0.1
KBC Group NV(a)	4.25%	10/24/2025	EUR	1,000	1,289,432	0.1
Lloyds Banking Group PLC(a)	6.66%	05/21/2037	USD	76	104,466	0.0
Lloyds Banking Group PLC(a)	7.50%	06/27/2024		434	490,152	0.0
Natwest Group PLC	2.00%	03/04/2025	EUR	115	147,564	0.0
PNC Financial Services Group, Inc. (The), Series R(a)	4.85%	06/01/2023	USD	120	125,700	0.0
Standard Chartered PLC(a)	7.50%	04/02/2022		1,215	1,269,456	0.1
Standard Chartered PLC(a)	7.75%	04/02/2023		730	795,959	0.1
Swedbank AB(a)	6.00%	03/17/2022		400	412,550	0.0
Swedbank AB, Series NC5(a)	5.63%	09/17/2024		200	216,486	0.0
UBS Group AG(a)	7.00%	02/19/2025		1,862	2,144,065	0.2
				22,314,637	1.7	
MAKLER						
Charles Schwab Corp. (The), Series G(a)	5.38%	06/01/2025		743	821,910	0.1
FINANZEN						
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023		238	247,043	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025		212	247,677	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028		124	121,944	0.0
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024		66	70,275	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026		15	16,246	0.0
Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023		162	173,635	0.0
Aircastle Ltd.	5.00%	04/01/2023		14	14,995	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025		1,123	1,251,180	0.1
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026		39	38,813	0.0
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022		513	518,679	0.1
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027		145	151,818	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023		354	370,999	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025		222	238,750	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024		135	144,994	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025		166	183,351	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024		380	428,560	0.1
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	3.75%	04/27/2022		347	261,985	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026		213	141,645	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025		500	346,250	0.0
Synchrony Financial	4.25%	08/15/2024		142	155,653	0.0
Synchrony Financial	4.38%	03/19/2024		212	232,284	0.0
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025		247	277,063	0.0
				5,633,839	0.4	

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSICHERUNGEN					
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	USD 80	\$ 103,254	0.0%
Centene Corp.	5.38%	08/15/2026	37	38,708	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR 290	363,846	0.1
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	USD 100	138,122	0.0
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	60	101,699	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.	9.38%	08/15/2039	30	50,603	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	28	30,081	0.0
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	81	87,556	0.0
Transatlantic Holdings, Inc.	8.00%	11/30/2039	20	30,441	0.0
				<u>944,310</u>	<u>0.1</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	243	<u>266,531</u>	<u>0.0</u>
REITS					
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	46	51,969	0.0
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026	35	40,002	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	376	400,701	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027	471	496,497	0.0
Sabra Health Care LP	4.80%	06/01/2024	74	81,150	0.0
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	795	876,140	0.1
Weyerhaeuser Co.	7.38%	03/15/2032	20	28,716	0.0
				<u>1,975,175</u>	<u>0.1</u>
				<u>31,956,402</u>	<u>2.4</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Glencore Finance Canada Ltd.	6.00%	11/15/2041	9	11,594	0.0
Glencore Funding LLC	4.63%	04/29/2024	11	12,132	0.0
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024	250	272,312	0.0
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	200	216,939	0.0
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	282	329,993	0.1
International Paper Co.	3.80%	01/15/2026	34	38,034	0.0
MEGlobal Canada ULC.	5.00%	05/18/2025	238	268,231	0.0
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027	1,106	1,149,947	0.1
Vale Overseas Ltd.	3.75%	07/08/2030	104	110,409	0.0
WestRock MWV LLC	8.20%	01/15/2030	10	14,036	0.0
				<u>2,423,627</u>	<u>0.2</u>
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co., Series D(a) (e)	3.51%	09/15/2021	266	<u>254,964</u>	<u>0.0</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Prosus NV	3.68%	01/21/2030	509	537,822	0.1
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	234	220,959	0.0
TCI Communications, Inc.	7.88%	02/15/2026	60	77,964	0.0
				<u>836,745</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Hughes Satellite Systems Corp.	5.25%	08/01/2026	41	45,616	0.0
Qwest Corp.	6.75%	12/01/2021	460	472,651	0.0
				<u>518,267</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Co.	4.88%	10/02/2023	255	278,949	0.0
General Motors Co.	6.13%	10/01/2025	86	102,295	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	121	152,819	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	3.25%	01/05/2023	105	109,247	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	3.50%	11/07/2024	57	61,535	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	3.70%	05/09/2023	168	176,941	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	3.95%	04/13/2024	105	113,688	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.15%	06/19/2023	65	69,345	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.25%	05/15/2023	14	14,955	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.30%	07/13/2025	119	132,148	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.10%	01/17/2024	182	201,480	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.20%	03/20/2023	110	118,920	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.25%	03/01/2026	69	79,943	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029	423	511,282	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	489	522,592	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	199	211,962	0.0
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027	213	234,937	0.0
Lear Corp.	4.25%	05/15/2029	149	166,792	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp.	2.60%	09/28/2022	31	31,721	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp.	2.80%	01/13/2022	27	27,352	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp.	3.45%	03/15/2023	42	43,898	0.0
Nissan Motor Acceptance Corp.	3.88%	09/21/2023	145	154,565	0.0
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	544	594,365	0.1
				<u>4,111,731</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Lennar Corp.	4.75%	11/29/2027	USD 3	\$ 3,470	0.0%
Marriott International, Inc./MD, Series EE	5.75%	05/01/2025	176	204,293	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	2,054	2,610,562	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	12	16,855	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	16	20,853	0.0
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	30	42,575	0.0
				<u>2,898,608</u>	<u>0.2</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Sysco Corp.	5.95%	04/01/2030	61	77,821	0.0
ENERGIE					
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	3	3,954	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	487	571,235	0.1
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045	62	64,015	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	537	634,331	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	382	390,264	0.0
Enable Midstream Partners LP	4.40%	03/15/2027	781	863,608	0.1
Enable Midstream Partners LP	4.95%	05/15/2028	129	146,297	0.0
Energy Transfer LP	3.90%	07/15/2026	60	65,643	0.0
Energy Transfer LP	4.75%	01/15/2026	650	730,668	0.1
Energy Transfer Partners LP/Regency Energy Finance Corp.	4.50%	11/01/2023	94	101,121	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	251	251,000	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.80%	08/01/2031	80	112,308	0.0
Marathon Petroleum Corp.	4.50%	05/01/2023	451	482,766	0.0
Marathon Petroleum Corp.	4.70%	05/01/2025	391	443,342	0.0
Marathon Petroleum Corp.	4.75%	12/15/2023	62	67,957	0.0
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	515	531,583	0.0
ONEOK, Inc.	2.20%	09/15/2025	213	219,514	0.0
ONEOK, Inc.	2.75%	09/01/2024	753	796,208	0.1
ONEOK, Inc.	5.85%	01/15/2026	427	507,417	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	206	230,848	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.65%	10/15/2025	566	632,833	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	244	275,488	0.0
				<u>8,122,400</u>	<u>0.6</u>
DIENTSTLEISTUNGEN					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	88	102,616	0.0
Verisk Analytics, Inc.	5.50%	06/15/2045	19	24,917	0.0
				<u>127,533</u>	<u>0.0</u>
TECHNOLOGIE					
CDW LLC/CDW Finance Corp.	4.13%	05/01/2025	382	399,306	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	224	262,962	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	6.02%	06/15/2026	89	106,200	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	8.35%	07/15/2046	9	14,142	0.0
Nokia Oyj.	6.63%	05/15/2039	40	51,850	0.0
				<u>834,460</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	719	836,486	0.1
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	475	518,762	0.0
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	1,646	1,806,708	0.1
				<u>3,161,956</u>	<u>0.2</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	200	204,500	0.0
				<u>23,572,612</u>	<u>1.7</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Colbun SA	3.15%	03/06/2030	404	411,777	0.1
Consortio Transmataro SA	4.38%	05/07/2023	200	210,184	0.0
Enel Generacion Chile SA	4.25%	04/15/2024	70	74,694	0.0
				<u>696,655</u>	<u>0.1</u>
				<u>56,225,669</u>	<u>4.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(a)	6.38%	05/27/2026	237	241,666	0.0
VERSICHERUNGEN					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(b)	7.63%	10/15/2025	348	369,241	0.1
				<u>610,907</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Braskem Finance Ltd.	6.45%	02/03/2024	USD 602	\$ 681,228	0.1%
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	778	819,818	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	441	457,538	0.0
Consolidated Energy Finance SA	6.50%	05/15/2026	205	205,922	0.0
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025	2,265	2,281,843	0.2
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	252	277,193	0.0
CSN Resources SA	7.63%	02/13/2023	469	486,969	0.0
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	1,220	1,311,347	0.1
Eldorado Gold Corp.	9.50%	06/01/2024	387	421,818	0.0
First Quantum Minerals Ltd.	6.88%	10/15/2027	645	705,134	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	04/01/2023	2,080	2,121,600	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	776	828,040	0.1
OCP SA	5.63%	04/25/2024	290	316,154	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	947	1,044,270	0.1
Volcan Cia Minera SAA.	4.38%	02/11/2026	119	116,159	0.0
				<u>12,075,033</u>	<u>0.9</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	424	478,405	0.0
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	509	540,976	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	410	466,546	0.0
Klabin Austria GmbH	7.00%	04/03/2049	822	1,021,675	0.1
				<u>2,507,602</u>	<u>0.2</u>
KOMMUNIKATIONS MEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	695	707,293	0.1
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028	212	224,063	0.0
				<u>931,356</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	426	453,713	0.0
C&W Senior Financing DAC	7.50%	10/15/2026	440	463,351	0.1
Digicel International Finance Ltd./					
Digicel international Holdings Ltd.	8.75%	05/25/2024	97	100,347	0.0
MTN Mauritius Investments Ltd.	5.37%	02/13/2022	200	204,913	0.0
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	1,106	1,164,532	0.1
VTR Comunicaciones SpA	5.13%	01/15/2028	212	218,413	0.0
				<u>2,605,269</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	261	271,667	0.0
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	767	778,696	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	470	491,150	0.0
				<u>1,541,513</u>	<u>0.1</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	412	430,537	0.0
BRF SA	4.88%	01/24/2030	1,148	1,192,700	0.1
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV	7.13%	01/31/2025	260	283,892	0.0
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	232	250,459	0.0
				<u>2,157,588</u>	<u>0.1</u>
ENERGIE					
Cosan Ltd.	5.50%	09/20/2029	225	240,581	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	245	209,782	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	357	384,937	0.0
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	266	255,359	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	203	222,937	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	371	412,106	0.1
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	200	218,287	0.0
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	189	202,986	0.0
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030	964	757,523	0.1
Petrobras Global Finance BV	5.60%	01/03/2031	393	433,663	0.1
Petrobras Global Finance BV	6.90%	03/19/2049	220	255,831	0.0
Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026	25	32,009	0.0
SEPLAT Petroleum Development Co. PLC	7.75%	04/01/2026	288	296,640	0.0
				<u>3,922,641</u>	<u>0.3</u>
				<u>25,741,002</u>	<u>1.9</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
AES Gener SA	6.35%	10/07/2079	210	222,604	0.0
Cemig Geracao e Transmissao SA.	9.25%	12/05/2024	1,417	1,633,801	0.2
Light Servicos de Eletricidade SA/Light Energia SA	7.25%	05/03/2023	429	445,302	0.0
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	177	201,647	0.0
				<u>2,503,354</u>	<u>0.2</u>
				<u>28,855,263</u>	<u>2.2</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3346, Class SC(e) (f)	6.45%	10/15/2033	USD 9,279	\$ 1,902,404	0.1%
Series 4954, Class SL(e) (f)	5.96%	02/25/2050	11,739	2,212,495	0.2
				<u>4,114,899</u>	<u>0.3</u>
RISIKOTEILUNG – VARIABLE VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2019-1A, Class M2(e)	2.79%	03/25/2029	235	235,731	0.0
Series 2019-2A, Class M1C(e)	2.09%	04/25/2029	205	206,189	0.0
Series 2019-3A, Class M1C(e)	2.04%	07/25/2029	208	208,000	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1B1(e)	4.44%	04/25/2031	24	24,707	0.0
Series 2018-R07, Class 1M2(e)	2.49%	04/25/2031	274	275,333	0.0
Series 2019-R02, Class 1M2(e)	2.39%	08/25/2031	70	70,889	0.0
Series 2019-R07, Class 1M2(e)	2.19%	10/25/2039	596	599,153	0.1
Series 2020-SBT1, Class 1M2(e)	3.74%	02/25/2040	598	610,691	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(e)	3.74%	02/25/2040	237	243,761	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2015-DNA3, Class B(e)	9.44%	04/25/2028	246	290,486	0.0
Series 2016-DNA3, Class B(e)	11.34%	12/25/2028	247	291,323	0.0
Series 2017-DNA1, Class B1(e)	5.04%	07/25/2029	250	268,228	0.0
Series 2017-DNA3, Class M2(e)	2.59%	03/25/2030	250	255,401	0.0
Series 2017-HQA1, Class M2(e)	3.64%	08/25/2029	210	216,705	0.0
Series 2017-HQA3, Class M2(e)	2.44%	04/25/2030	180	183,866	0.0
Series 2018-DNA1, Class B1(e)	3.24%	07/25/2030	110	110,481	0.0
Series 2018-DNA1, Class M2(e)	1.89%	07/25/2030	213	214,262	0.0
Series 2018-HQA2, Class B1(e)	4.34%	10/25/2048	2,000	2,082,307	0.2
Series 2019-DNA1, Class M2(e)	2.74%	01/25/2049	182	185,024	0.0
Series 2019-DNA3, Class B1(e)	3.34%	07/25/2049	3,000	3,033,795	0.2
Series 2019-DNA3, Class M2(e)	2.14%	07/25/2049	19	19,529	0.0
Series 2019-HQA3, Class M2(e)	1.94%	09/25/2049	511	513,756	0.1
Series 2020-DNA1, Class M2(e)	1.79%	01/25/2050	979	983,055	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C02, Class 1M2(e)	2.69%	05/25/2024	32	31,706	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(e)	4.99%	11/25/2024	13	12,969	0.0
Series 2015-C02, Class 1M2(e)	4.09%	05/25/2025	17	17,121	0.0
Series 2015-C02, Class 2M2(e)	4.09%	05/25/2025	6	6,504	0.0
Series 2015-C04, Class 2M2(e)	5.64%	04/25/2028	82	86,950	0.0
Series 2016-C02, Class 1B(e)	12.34%	09/25/2028	20	24,786	0.0
Series 2016-C03, Class 2M2(e)	5.99%	10/25/2028	46	48,440	0.0
Series 2016-C05, Class 2B(e)	10.84%	01/25/2029	1,377	1,629,061	0.1
Series 2016-C05, Class 2M2(e)	4.54%	01/25/2029	24	25,399	0.0
Series 2016-C06, Class 1B(e)	9.34%	04/25/2029	38	42,884	0.0
Series 2016-C06, Class 1M2(e)	4.34%	04/25/2029	146	152,557	0.0
Series 2016-C07, Class 2B(e)	9.59%	05/25/2029	41	46,255	0.0
Series 2016-C07, Class 2M2(e)	4.44%	05/25/2029	69	71,779	0.0
Series 2017-C01, Class 1B1(e)	5.84%	07/25/2029	3,173	3,482,497	0.3
Series 2017-C02, Class 2M2(e)	3.74%	09/25/2029	370	383,431	0.0
Series 2017-C03, Class 1B1(e)	4.94%	10/25/2029	423	451,884	0.1
Series 2017-C05, Class 1B1(e)	3.69%	01/25/2030	229	238,587	0.0
Series 2017-C06, Class 1B1(e)	4.24%	02/25/2030	921	949,689	0.1
Series 2017-C06, Class 2M2(e)	2.89%	02/25/2030	153	156,423	0.0
Series 2017-C07, Class 1M2(e)	2.49%	05/25/2030	173	175,988	0.0
Series 2017-C07, Class 2M2(e)	2.59%	05/25/2030	271	275,410	0.0
Series 2018-C01, Class 1B1(e)	3.64%	07/25/2030	248	253,769	0.0
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M2(e)	3.09%	10/25/2028	150	151,698	0.0
Mortgage Insurance-Linked Notes, Series 2019-1, Class M2(e)	2.99%	11/26/2029	850	850,000	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2020-1, Class M1B(e)	1.54%	01/25/2030	397	396,763	0.1
Triangle Re Ltd., Series 2020-1, Class M2(e)	5.69%	10/25/2030	230	237,704	0.0
				<u>21,322,926</u>	<u>1.6</u>
				<u>25,437,825</u>	<u>1.9</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
iShares JP Morgan USD Emerging Markets Bond ETF			20,841	2,319,395	0.2
iShares S&P 500 Energy Sector UCITS ETF			1,837,710	8,453,466	0.6
iShares S&P 500 Financials Sector UCITS ETF USD ACC			785,900	8,173,360	0.6
iShares S&P 500 Industrials Sector UCITS ETF			642,010	5,356,771	0.4
				<u>24,302,992</u>	<u>1.8</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE						
QUASI-STAAATSANLEIHEN						
BAHRAIN						
	Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	7.50%	10/25/2027	USD 433	\$ 485,988	0.1%
	Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	8.38%	11/07/2028	200	233,725	0.0
					<u>719,713</u>	<u>0.1</u>
INDONESIEN						
	Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	269	310,157	0.0
MEXIKO						
	Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	2,760	2,684,100	0.2
	Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	855	912,841	0.1
	Petroleos Mexicanos	6.50%	01/23/2029	346	353,698	0.0
	Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	1,518	1,341,457	0.1
	Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030	712	736,130	0.0
	Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	516	453,306	0.0
	Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	2,207	2,125,341	0.2
					<u>8,606,873</u>	<u>0.6</u>
SÜDAFRIKA						
	Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	345	365,484	0.0
TRINIDAD & TOBAGO						
	Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	260	266,468	0.0
UKRAINE						
	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2026	520	526,597	0.1
	State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025	183	196,883	0.0
					<u>723,480</u>	<u>0.1</u>
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE						
	DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029	209	223,638	0.0
	DP World PLC	5.63%	09/25/2048	249	303,904	0.0
	DP World Salaam(a)	6.00%	10/01/2025	311	342,100	0.1
					<u>869,642</u>	<u>0.1</u>
VENEZUELA						
	Petroleos de Venezuela SA(c)	5.38%	04/12/2027	110	4,950	0.0
					<u>11,866,767</u>	<u>0.9</u>
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE						
BRASILIEN						
	Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2023	BRL 4,364	875,458	0.1
	Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2025	5,785	1,177,556	0.1
					<u>2,053,014</u>	<u>0.2</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK						
	Dominican Republic International Bond	15.95%	06/04/2021	DOP 6,500	114,859	0.0
SÜDAFRIKA						
	Republic of South Africa Government Bond, Series 2030	8.00%	01/31/2030	ZAR 34,207	2,345,098	0.2
	Republic of South Africa Government Bond, Series 2032	8.25%	03/31/2032	48,792	3,205,758	0.2
					<u>5,550,856</u>	<u>0.4</u>
					<u>7,718,729</u>	<u>0.6</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN						
CLO – VARIABEL VERZINSLICH						
	AGL CLO 11 Ltd., Series 2021-11A, Class E(e)	0.00%	04/15/2034	USD 250	247,500	0.0
	Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class D(e)	7.20%	01/20/2034	250	250,486	0.0
	Invesco CLO 2021-1 Ltd., Series 2021-1A, Class E(e)	6.63%	04/15/2034	400	397,623	0.1
	Jamestown CLO XI Ltd., Series 2018-11A, Class D(e)	6.21%	07/14/2031	250	239,737	0.0
	Neuberger Berman Loan Advisers CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class E(e)	6.09%	07/16/2035	250	250,000	0.0
	Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class E(e)	7.39%	01/20/2032	250	250,443	0.0
	PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(e)	6.13%	07/15/2031	250	237,539	0.0
					<u>1,873,328</u>	<u>0.1</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN						
ISRAEL						
	Israel Government International Bond	2.75%	07/03/2030	494	522,371	0.0
MEXIKO						
	Mexico Government International Bond	4.75%	04/27/2032	297	337,522	0.1
	Mexico Government International Bond	5.00%	04/27/2051	276	308,482	0.0
					<u>646,004</u>	<u>0.1</u>
PHILIPPINEN						
	Philippine Government International Bond	9.50%	02/02/2030	20	31,591	0.0
					<u>1,199,966</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
GS Mortgage Securities Trust, Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	USD 493	\$ 300,687	0.1%
UBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(g)	1.52%	06/15/2050	1,978	137,078	0.0
				437,765	0.1
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(e)	3.12%	12/19/2030	100	99,377	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class E(e) . .	4.85%	05/15/2036	34	21,781	0.0
				121,158	0.0
				558,923	0.1
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Taco Bell Funding LLC, Series 2016-1A, Class A23	4.97%	05/25/2046	38	41,696	0.0
OPTIONSSCHEINE					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
INTERNET-SOFTWARE UND -DIENSTE					
Avaya Holdings Corp., expiring 12/15/2022			1,190	9,520	0.0
				1,123,771,168	84.8
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABLE VERZINSLICH					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2020-DNA2, Class B2(e)	4.89%	02/25/2050	USD 4,000	3,799,750	0.3
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(e) . .	2.44%	02/27/2023	477	477,068	0.0
				4,276,818	0.3
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Lloyds Banking Group PLC(a)	6.00%	06/07/2032	33	44,260	0.0
Natwest Group PLC(a)	8.63%	08/15/2021	1,908	1,934,490	0.1
				1,978,750	0.1
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Smurfit Kappa Treasury Funding DAC	7.50%	11/20/2025	30	37,180	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Standard Industries, Inc./NJ	4.38%	07/15/2030	257	260,045	0.0
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.50%	10/20/2025	409	440,372	0.1
				737,597	0.1
				2,716,347	0.2
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Kleopatra Finco SARL	4.25%	03/01/2026	EUR 567	691,780	0.1
INVESTITIONSGÜTER					
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	214	270,844	0.0
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Banjay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025	156	191,711	0.0
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	306	389,122	0.1
				580,833	0.1
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp.(h)	6.00%	10/15/2024	USD 58	0	0.0
Gulfport Energy Corp.(h)	6.38%	05/15/2025	1,401	0	0.0
Gulfport Energy Corp.(h)	6.38%	01/15/2026	571	0	0.0
Gulfport Energy Corp.(h)	6.63%	05/01/2023	57	0	0.0
Vantage Drilling International(h)	7.50%	11/01/2019	40	0	0.0
				0	0.0
DIENTSTLEISTUNGEN					
Monitronics International, Inc.(h) (i)	9.13%	04/01/2020	40	0	0.0
TECHNOLOGIE					
Sensata Technologies, Inc.	3.75%	02/15/2031	590	577,077	0.0
				2,120,534	0.2

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Digicel Group Holdings Ltd. (b)	10.00%	04/01/2024	USD 1,303	\$ 1,280,396	0.1%
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	117	120,546	0.0
				1,400,942	0.1
STAMMAKTIEN					
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
ATD New Holdings, Inc. (h)			1,384	66,432	0.0
VERBRAUCHSGÜTER					
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL					
Southeastern Grocers, Inc. (h)			4,735	66,290	0.0
ENERGIE					
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE					
Diamond Offshore Drilling, Inc. (h)			12,711	65,568	0.0
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Battalion Oil Corp.			1	13	0.0
Keyera Corp.			45,264	1,122,561	0.1
Paragon Offshore Ltd. - Class A (h)			152	15	0.0
Paragon Offshore Ltd. - Class B (h)			228	2,280	0.0
Vantage Drilling International			213	479	0.0
				1,125,348	0.1
				1,190,916	0.1
INDUSTRIEGÜTER					
BAU- UND INGENIEURWESEN					
Willscot Corp.			556	16,124	0.0
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
SOFTWARE					
Monitronics International, Inc.			1,489	12,731	0.0
GRUNDSTOFFE					
METALL UND BERGBAU					
BIS Industries Holdings Ltd. (h)			8,912	0	0.0
				1,352,493	0.1
VORZUGSAKTIEN					
FINANZINSTITUTE					
REITS					
Cedar Realty Trust, Inc. Series B.	7.25%		35,391	898,224	0.1
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABLE VERZINSLICH					
Bardot CLO Ltd., Series 2019-2A, Class C(e)	2.93%	10/22/2032	USD 250	250,860	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2019-3A, Class B(e)	2.83%	07/16/2032	250	250,163	0.0
				501,023	0.0
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
SCHATZPAPIERE					
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6217.	7.50%	08/18/2021	RUB 11,226	154,000	0.0
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-LC9, Class G	4.42%	12/15/2047	USD 171	119,145	0.0
OPTIONSSCHEINE					
BAU- UND INGENIEURWESEN					
INDUSTRIEGÜTER					
Willscot Corp., expiring 11/29/2022 (h)			861	12,073	0.0
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
ENERGIE					
Battalion Oil Corp., expiring 10/08/2022(h)			21	0	0.0
				12,073	0.0
				13,551,599	1.0

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Gesamtanlagen				
(Kosten \$1,036,571,254)			\$ 1,137,322,767	85.8%
Termineinlagen				
ANZ, London(j)	(0.13)%	—	91,801	0.0
BNP Paribas Bank(j)	(0.53)%	—	27,323	0.0
BNP Paribas Bank(j)	0.01 %	—	21,857	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	0.00 %	—	35,660	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	2.99 %	—	416,426	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(j)	(1.44)%	—	40,014	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(j)	0.00 %	—	707,589	0.1
Nordea Bank Abp, Oslo(j)	(0.78)%	—	4,432,507	0.3
Nordea Bank Abp, Oslo(j)	(0.13)%	—	31,697	0.0
Royal Bank of Canada, Toronto(j)	0.01 %	—	51,671	0.0
SEB, Stockholm(j)	(0.28)%	—	337,575	0.0
Sumitomo, London(j)	(0.29)%	—	855,284	0.1
Sumitomo, London(j)	0.01 %	—	23,604,407	1.8
Sumitomo, Tokyo(j)	0.01 %	—	132,419,380	10.0
Termineinlagen insgesamt			163,073,191	12.3
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			25,184,938	1.9
Nettovermögen			\$ 1,325,580,896	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
10 Yr Australian Bond Futures	06/15/2021	125	\$ 13,388,127	\$ 13,507,495	\$ 119,368
BIST 30 Futures	06/30/2021	2,129	3,812,654	3,800,920	(11,734)
Canadian 10 Yr Bond Futures	09/21/2021	39	4,644,129	4,656,885	12,756
Euro STOXX 50 Index Futures	06/18/2021	92	4,486,637	4,561,621	74,984
FTSE 100 Index Futures	06/18/2021	4	399,696	398,696	(1,000)
FTSE KLCI Futures	06/30/2021	427	8,143,005	8,220,279	77,274
Hang Seng Index Futures	06/29/2021	29	5,369,017	5,415,570	46,553
MSCI Singapore IX ETS Futures	06/29/2021	75	2,028,960	2,050,095	21,135
SPI 200 Index Futures	06/17/2021	17	2,321,438	2,350,763	29,325
TOPIX Index Futures	06/10/2021	10	1,753,357	1,773,569	20,212
U.S. Long Bond (CBT) Futures	09/21/2021	11	1,727,258	1,721,844	(5,414)
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	57	7,047,492	7,059,539	12,047
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2021	41	7,618,219	7,595,250	(22,969)
WIG 20 Index Futures	06/18/2021	259	2,840,977	3,147,591	306,614
Short					
Euro-Bund Futures	06/08/2021	102	21,171,749	21,137,800	33,949
FTSE China A50 Futures	06/29/2021	36	653,545	656,424	(2,879)
FTSE/JSE Top 40 Futures	06/17/2021	11	491,021	491,076	(55)
Japan 10 Yr Bond (OSE) Futures	06/14/2021	24	33,038,239	33,088,906	(50,667)
Long Gilt Futures	09/28/2021	59	10,640,389	10,654,623	(14,234)
Mexican Bolsa Index Futures	06/18/2021	85	2,082,704	2,142,923	(60,219)
OMXS 30 Index Futures	06/18/2021	64	1,728,309	1,741,781	(13,472)
S&P 500 E-Mini Futures	06/18/2021	202	41,043,768	42,445,250	(1,401,482)
S&P/TSX 60 Index Futures	06/17/2021	7	1,348,408	1,376,532	(28,124)
SGX Nifty 50 Futures	06/24/2021	304	9,329,929	9,419,440	(89,511)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	09/21/2021	586	77,325,641	77,315,375	10,266
					\$ (937,277)
				Wertsteigerung	\$ 764,483
				Wertminderung	\$ (1,701,760)

DEISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	AUD 977	USD 756	06/16/2021	\$ 2,931
Bank of America, NA.	JPY 115,559	USD 1,094	06/16/2021	42,079
Bank of America, NA.	USD 1,740	JPY 189,955	06/16/2021	(10,821)
Bank of America, NA.	GBP 1,456	USD 2,022	06/17/2021	(44,206)
Bank of America, NA.	USD 2,020	ZAR 28,671	06/17/2021	56,262
Bank of America, NA.	ZAR 49,575	USD 3,381	06/17/2021	(209,541)
Bank of America, NA.	DKK 10,786	USD 1,733	07/15/2021	(36,710)
Bank of America, NA.	SEK 13,747	USD 1,634	07/15/2021	(21,687)
Bank of America, NA.	RUB 494,094	USD 6,650	07/28/2021	(40,072)

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	USD	15,711	RUB	1,167,289	07/28/2021	\$ 94,671
Barclays Bank PLC	GBP	4,669	USD	6,575	06/15/2021	(51,459)
Barclays Bank PLC	EUR	2,933	USD	3,586	06/16/2021	8,411
Barclays Bank PLC	NZD	6,227	USD	4,470	06/16/2021	(40,725)
Barclays Bank PLC	USD	5,360	MXN	108,267	06/18/2021	65,511
Barclays Bank PLC	KRW	3,998,869	USD	3,583	07/22/2021	(6,818)
Barclays Bank PLC	USD	6,794	PHP	333,817	07/22/2021	168,590
Barclays Bank PLC	MYR	29,314	USD	7,082	09/23/2021	10,221
Barclays Bank PLC	USD	3,739	MYR	15,555	09/23/2021	13,546
Barclays Bank PLC	USD	4,558	MYR	18,821	09/23/2021	(18,455)
BNP Paribas SA	AUD	546	USD	424	06/04/2021	3,162
BNP Paribas SA	CHF	6,339	USD	7,030	06/16/2021	(19,461)
BNP Paribas SA	USD	7,852	EUR	6,463	06/16/2021	31,114
BNP Paribas SA	USD	9,900	SEK	82,660	06/16/2021	55,530
BNP Paribas SA	USD	700	ZAR	9,776	06/17/2021	7,529
BNP Paribas SA	CZK	147,427	USD	6,863	06/24/2021	(197,755)
BNP Paribas SA	SEK	26,751	USD	3,139	07/15/2021	(83,683)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	5,207	USD	3,964	06/04/2021	(49,973)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	346	AUD	447	06/04/2021	(1,537)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	122	USD	96	06/15/2021	2,123
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	674	USD	558	06/15/2021	573
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	876	USD	724	06/15/2021	(1,194)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	97	USD	117	06/15/2021	(1,110)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	229	USD	322	06/15/2021	(2,362)
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN	2,497	USD	125	06/15/2021	183
Brown Brothers Harriman & Co.	SGD	528	USD	396	06/15/2021	(3,166)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	60	EUR	49	06/15/2021	253
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	25	SGD	33	06/15/2021	254
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	1,702	USD	120	06/15/2021	(3,330)
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD	463	USD	359	06/16/2021	1,691
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	1,045	USD	822	06/16/2021	(42,618)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	530	USD	597	06/16/2021	8,009
Brown Brothers Harriman & Co.	DKK	4,211	USD	688	06/16/2021	(2,244)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	1,316	USD	1,599	06/16/2021	(6,570)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	475	USD	651	06/16/2021	(22,682)
Brown Brothers Harriman & Co.	HKD	3,830	USD	494	06/16/2021	560
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY	64,321	USD	614	06/16/2021	28,724
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	9,925	USD	1,184	06/16/2021	(11,679)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	682	DKK	4,211	06/16/2021	8,614
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	4	GBP	3	06/16/2021	70
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	247	HKD	1,914	06/16/2021	(68)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	281	SEK	2,343	06/16/2021	1,114
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	122	SEK	1,013	06/16/2021	(164)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	3,764	USD	5,187	06/17/2021	(155,124)
Brown Brothers Harriman & Co.	ZAR	399	USD	27	06/17/2021	(1,615)
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK	4,762	USD	573	07/15/2021	3,824
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	1,009	USD	120	07/15/2021	(1,603)
Brown Brothers Harriman & Co.	THB	79,858	USD	2,543	07/15/2021	(12,243)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	738	DKK	4,551	07/15/2021	9,238
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	6,818	THB	212,491	07/15/2021	(19,091)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	5,335	USD	4,263	07/16/2021	(153,099)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF	474	USD	529	08/05/2021	873
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	6,887	CNH	44,692	06/07/2021	128,852
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	31,405	GBP	22,494	06/07/2021	518,067
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	51,603	AUD	66,697	06/21/2021	(182,096)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	14,020	EUR	11,475	06/21/2021	(21,814)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	31,404	GBP	22,184	06/21/2021	79,187
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	685	SGD	913	06/21/2021	5,431
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	10,645	ZAR	150,019	06/21/2021	213,489
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	60,193	AUD	77,583	06/30/2021	(376,586)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	23,386	CAD	28,331	06/30/2021	65,091
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	36	CHF	32	06/30/2021	(109)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	13,667	EUR	11,178	06/30/2021	(28,947)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	46,158	JPY	5,027,154	06/30/2021	(378,041)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	19,258	NZD	26,387	06/30/2021	(144,088)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	769	SGD	1,019	06/30/2021	1,250
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	12,158	ZAR	168,749	06/30/2021	41,390
Citibank, NA	AUD	12,257	USD	9,498	06/16/2021	48,149
Citibank, NA	EUR	427	USD	509	06/16/2021	(11,967)
Citibank, NA	GBP	3,189	USD	4,496	06/16/2021	(30,694)
Citibank, NA	JPY	54,820	USD	522	06/16/2021	23,326
Citibank, NA	NZD	1,314	USD	946	06/16/2021	(5,960)
Citibank, NA	COP	61,749,436	USD	16,437	07/15/2021	(173,223)
Citibank, NA	PEN	29,030	USD	7,942	07/15/2021	307,222

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citibank, NA	USD 5,856	COP 21,893,500	07/15/2021	\$ 33,045
Citibank, NA	NZD 1,031	USD 746	07/29/2021	(511)
Credit Suisse International	HUF 167,868	USD 541	06/24/2021	(46,886)
Credit Suisse International	USD 7,315	CNH 47,830	06/24/2021	194,884
Credit Suisse International	USD 2,536	PLN 10,070	06/24/2021	203,465
Deutsche Bank AG	NOK 14,588	USD 1,760	06/15/2021	15,819
Deutsche Bank AG	SEK 12,687	USD 1,517	06/15/2021	(10,518)
Deutsche Bank AG	AUD 2,906	USD 2,251	06/16/2021	10,178
Deutsche Bank AG	CAD 4,078	USD 3,372	06/16/2021	(3,312)
Deutsche Bank AG	GBP 3,595	USD 5,041	06/16/2021	(61,250)
Deutsche Bank AG	USD 8,587	CAD 10,400	06/16/2021	21,516
Deutsche Bank AG	USD 549	SEK 4,585	06/16/2021	2,882
Deutsche Bank AG	HUF 2,177,706	USD 7,075	06/24/2021	(548,906)
Deutsche Bank AG	USD 8,572	INR 637,953	07/15/2021	172,348
Deutsche Bank AG	USD 3,348	PEN 12,231	07/15/2021	(131,273)
Deutsche Bank AG	USD 1,136	RUB 84,206	07/28/2021	4,138
Goldman Sachs International	BRL 38,570	USD 7,261	06/02/2021	(139,738)
Goldman Sachs International	USD 4,046	BRL 21,740	06/02/2021	125,453
Goldman Sachs International	SGD 2,246	USD 1,684	06/15/2021	(14,322)
Goldman Sachs International	CHF 3,703	USD 4,059	06/16/2021	(59,635)
Goldman Sachs International	GBP 1,524	USD 2,156	06/16/2021	(7,032)
Goldman Sachs International	JPY 59,384	USD 547	06/16/2021	5,838
Goldman Sachs International	USD 3,221	EUR 2,663	06/16/2021	27,742
Goldman Sachs International	USD 1,392	JPY 151,099	06/16/2021	(15,836)
Goldman Sachs International	USD 4,447	NOK 36,770	06/16/2021	(50,418)
Goldman Sachs International	USD 1,223	SEK 10,198	06/16/2021	4,827
Goldman Sachs International	GBP 410	USD 572	06/17/2021	(9,587)
Goldman Sachs International	HUF 555,676	USD 1,856	06/24/2021	(89,692)
Goldman Sachs International	USD 2,291	CNH 14,891	06/24/2021	46,656
Goldman Sachs International	USD 7,241	BRL 38,570	07/02/2021	138,395
Goldman Sachs International	USD 1,261	IDR 18,483,142	07/15/2021	25,574
Goldman Sachs International	TWD 38,402	USD 1,369	07/22/2021	(26,607)
HSBC Bank USA	CAD 4,753	USD 3,931	06/15/2021	(3,280)
HSBC Bank USA	DKK 7,551	USD 1,231	06/15/2021	(7,023)
HSBC Bank USA	ILS 2,866	USD 875	06/15/2021	(7,233)
HSBC Bank USA	SEK 10,913	USD 1,314	06/16/2021	(72)
HSBC Bank USA	ZAR 104,721	USD 7,134	06/17/2021	(449,334)
HSBC Bank USA	USD 2,528	IDR 37,378,910	07/15/2021	74,314
HSBC Bank USA	EUR 10,467	USD 12,840	08/03/2021	60,457
JPMorgan Chase Bank, NA	CHF 5,826	USD 6,454	06/15/2021	(24,762)
JPMorgan Chase Bank, NA	AUD 782	USD 605	06/16/2021	2,482
JPMorgan Chase Bank, NA	GBP 377	USD 524	06/16/2021	(11,570)
JPMorgan Chase Bank, NA	JPY 158,029	USD 1,512	06/16/2021	73,281
JPMorgan Chase Bank, NA	IDR 9,542,233	USD 646	07/15/2021	(18,578)
JPMorgan Chase Bank, NA	TWD 396,611	USD 14,328	07/22/2021	(87,238)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY 92,035	USD 843	06/15/2021	4,792
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 482	USD 581	06/16/2021	(6,575)
Morgan Stanley Capital Services LLC	MXN 191,653	USD 9,481	06/18/2021	(122,866)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CLP 5,260,129	USD 7,402	07/15/2021	144,234
Morgan Stanley Capital Services LLC	SEK 5,936	USD 712	07/15/2021	(2,939)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CHF 2,920	USD 3,208	08/05/2021	(43,749)
Morgan Stanley Capital Services LLC	JPY 1,136,788	USD 10,446	08/19/2021	89,725
Morgan Stanley Capital Services LLC	MYR 15,908	USD 3,873	09/23/2021	35,016
Royal Bank of Scotland PLC	CAD 642	USD 505	06/16/2021	(26,810)
Royal Bank of Scotland PLC	CHF 9,012	USD 9,997	06/16/2021	(25,305)
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 1,615	USD 1,964	06/16/2021	(5,515)
Royal Bank of Scotland PLC	JPY 332,213	USD 3,176	06/16/2021	151,291
Royal Bank of Scotland PLC	USD 735	GBP 527	06/16/2021	13,389
Royal Bank of Scotland PLC	PLN 23,654	USD 6,241	06/24/2021	(193,460)
Standard Chartered Bank	CLP 1,317,923	USD 1,872	07/15/2021	53,682
Standard Chartered Bank	IDR 28,297,128	USD 1,966	07/15/2021	(3,737)
Standard Chartered Bank	USD 1,986	COP 7,336,800	07/15/2021	(12,567)
Standard Chartered Bank	USD 11,337	INR 853,391	07/15/2021	361,147
Standard Chartered Bank	KRW 2,930,529	USD 2,600	07/22/2021	(30,691)
Standard Chartered Bank	TWD 138,592	USD 4,937	07/22/2021	(99,808)
Standard Chartered Bank	USD 3,062	PHP 149,544	07/22/2021	57,579
UBS AG	USD 3,183	BRL 16,830	06/02/2021	45,905
UBS AG	AUD 3,325	USD 2,581	06/15/2021	18,008
UBS AG	EUR 11,902	USD 14,426	06/15/2021	(91,248)
UBS AG	JPY 781,249	USD 7,149	06/15/2021	34,881
UBS AG	NZD 2,412	USD 1,733	06/16/2021	(13,973)
UBS AG	USD 4,283	SEK 35,969	06/16/2021	48,509
UBS AG	HUF 434,074	USD 1,481	06/24/2021	(38,744)
UBS AG	USD 2,798	PLN 10,445	06/24/2021	43,289

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
UBS AG	CAD 657	USD 535	07/16/2021	\$ (8,974)
UBS AG	USD 191	TWD 5,306	07/22/2021	1,463
UBS AG	EUR 9,106	USD 11,166	08/03/2021	47,708
				<u>\$ (726,938)</u>
			Wertsteigerung	\$ 4,451,026
			Wertminderung	\$ (5,177,964)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

VERKAUFTE KAUFPTIONEN

Bezeichnung	Ausübungs- preis	Fälligkeit	Kontrakte	Prämien erhalten	Marktwert
FTSE 100 Index (k)	GBP 7,200	06/18/2021	500	\$ 28,239	\$ (8,363)
Nikkei 225 Index (k)	JPY 29,750	06/11/2021	31,000	32,027	(37,898)
S&P 500 Index (k)	EUR 4,150	06/18/2021	2,280	41,536	(38,925)
S&P 500 Index (k)	USD 4,295	06/18/2021	17,500	315,000	(175,984)
				<u>\$ 416,802</u>	<u>\$ (261,170)</u>

VERKAUFTE VERKAUFSOPTIONEN

Bezeichnung	Ausübungs- preis	Fälligkeit	Kontrakte	Prämien erhalten	Marktwert
FTSE 100 Index (k)	GBP 6,800	06/18/2021	500	\$ 49,418	\$ (19,868)
Nikkei 225 Index (k)	JPY 27,125	06/11/2021	31,000	103,451	(10,675)
S&P 500 Index (k)	EUR 3,750	06/18/2021	2,280	74,765	(19,462)
S&P 500 Index (k)	USD 4,000	06/18/2021	17,500	687,750	(212,146)
				<u>\$ 915,384</u>	<u>\$ (262,151)</u>

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 36, 5 Year Index	06/20/2026	USD 47,550	\$ (4,598,243)	\$ (46,000)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025	6,993	669,041	572,580
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	12/20/2025	6,479	629,587	299,621
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	06/20/2026	50,973	4,929,258	219,102
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 33, 5 Year Index	06/20/2026	EUR 14,720	2,121,981	202,132
Insgesamt				<u>\$ 3,751,624</u>	<u>\$ 1,247,435</u>
				Wertsteigerung	\$ 1,293,435
				Wertminderung	\$ (46,000)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CNY 10,900	02/17/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.547%	\$ (8,009)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	32,439	02/20/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.598%	(14,799)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	32,921	02/21/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.620%	(10,907)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	65,190	02/26/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.496%	(67,615)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 97,690	01/07/2030	6 Month LIBOR	0.132%	3,336
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 750	02/19/2030	6 Month BBSW	1.169%	(18,313)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	2,070	06/09/2030	6 Month BBSW	1.116%	(64,902)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP 2,930	06/10/2030	6 Month LIBOR	0.487%	(179,727)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 2,860	06/11/2030	6 Month BBSW	0.992%	(113,329)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 603,380	06/12/2030	6 Month LIBOR	0.038%	(30,877)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP 860	08/03/2030	6 Month LIBOR	0.294%	(75,584)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 342,850	08/05/2030	6 Month LIBOR	0.010%	(26,881)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP 1,780	10/20/2030	6 Month LIBOR	0.363%	(146,805)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 8,730	10/21/2030	6 Month BBSW	0.718%	(549,844)

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 857,330	10/22/2030	6 Month LIBOR	0.031%	\$ (57,754)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 50	11/09/2030	3 Month CDOR	1.230%	(2,405)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	GBP 1,680	11/10/2030	6 Month LIBOR	0.567%	(95,111)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NOK 28,920	11/11/2030	6 Month NIBOR	1.031%	(217,296)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 8,120	11/11/2030	6 Month BBSW	0.900%	(415,284)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 869,960	11/12/2030	6 Month LIBOR	0.058%	(40,516)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR 2,430	11/12/2030	6 Month EURIBOR	(0.169)%	(71,960)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 2,150	11/23/2030	3 Month BKBm	0.841%	(154,359)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	2,410	01/05/2031	3 Month BKBm	0.978%	(155,570)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,690	01/11/2031	3 Month BKBm	1.058%	(100,662)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 24,720	01/13/2031	3 Month LIBOR	1.150%	(867,034)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NOK 15,510	01/21/2031	6 Month NIBOR	1.348%	(68,512)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	20,280	02/19/2031	6 Month NIBOR	1.634%	(28,866)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 4,320	02/19/2031	3 Month BKBm	1.616%	(105,505)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 1,720	02/19/2031	(0.054)%	6 Month LIBOR	14,256
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 5,240	02/26/2031	3 Month CDOR	1.908%	431
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 6,020	03/01/2031	6 Month BBSW	1.831%	70,863
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 2,620	03/01/2031	0.068%	6 Month LIBOR	(12,706)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	1,550	04/06/2031	0.026%	6 Month LIBOR	696
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 2,306,840	04/16/2031	6 Month LIBOR	0.130%	13,027
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR 10,240	04/16/2031	6 Month EURIBOR	0.058%	(70,533)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	SEK 150	04/21/2031	3 Month STIBOR	0.786%	(47)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NOK 68,210	05/03/2031	6 Month NIBOR	1.786%	11,224
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 4,740	05/03/2031	3 Month BKBm	1.843%	(52,795)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 4,480	05/03/2031	0.084%	6 Month LIBOR	(24,243)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	NZD 9,660	05/18/2031	3 Month BKBm	1.985%	(18,292)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CHF 3,520	05/18/2031	0.079%	6 Month LIBOR	(16,339)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 2,340	05/26/2031	6 Month BBSW	1.685%	(812)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	USD 1,270	05/26/2031	3 Month LIBOR	1.576%	1,420
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 302,090	05/27/2031	6 Month LIBOR	0.119%	(2,151)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR 1,420	05/27/2031	6 Month EURIBOR	0.144%	3,932
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	JPY 397,010	03/10/2040	6 Month LIBOR	0.015%	(234,571)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	CAD 20	11/14/2048	3 Month CDOR	2.971%	1,938
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	360	02/04/2049	3 Month CDOR	2.696%	17,625
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	270	03/15/2049	3 Month CDOR	2.482%	3,051
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	AUD 240	03/19/2049	6 Month BBSW	2.535%	12,822
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	EUR 180	03/10/2050	6 Month EURIBOR	0.012%	(31,037)
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	10,640	07/16/2050	6 Month EURIBOR	(0.001)%	(1,895,645)
					\$ (5,892,976)
				Wertsteigerung	\$ 154,621
				Wertminderung	\$ (6,047,597)

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.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 17,090	\$ 4,807,417	\$ 4,176,597	\$ 630,820
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	158	(75,326)	(77,373)	2,047
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	43	(20,333)	(7,990)	(12,343)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	86	(40,667)	(16,106)	(24,561)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	86	(40,667)	(16,030)	(24,637)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	86	(40,667)	(15,702)	(24,965)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	128	(61,000)	(24,803)	(36,197)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	292	(138,637)	(66,612)	(72,025)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	257	(122,000)	(49,446)	(72,554)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	321	(152,500)	(62,736)	(89,764)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	749	(355,834)	(105,116)	(250,718)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	972	(462,123)	(134,981)	(327,142)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,167	(554,547)	(163,381)	(391,166)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,945	(924,245)	(292,822)	(631,423)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,383	(1,132,662)	(330,011)	(802,651)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,780	(2,271,794)	(657,520)	(1,614,274)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	250	(70,325)	(30,456)	(39,869)

Kontrahent	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nomineller Betrag (000)	Markt- wert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 400	\$ (112,520)	\$ (52,996)	\$ (59,524)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	900	(253,170)	(139,259)	(113,911)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,800	(506,340)	(112,231)	(394,109)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,300	(646,990)	(141,116)	(505,874)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,000	(1,969,100)	(350,194)	(1,618,906)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	850	(239,105)	(100,961)	(138,144)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,200	(337,560)	(165,337)	(172,223)
Goldman Sachs International	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	30	2,826	987	1,839
Goldman Sachs International	Avis Budget Group, Inc.	12/20/2023	20	1,884	1,030	854
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	32	(15,250)	(15,644)	394
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	32	(15,250)	(15,644)	394
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	86	(40,667)	(16,285)	(24,382)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	486	(231,061)	(129,020)	(102,041)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	200	(56,260)	(23,455)	(32,805)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	450	(126,585)	(42,731)	(83,854)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	830	(233,479)	(112,038)	(121,441)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	35	(16,636)	(6,657)	(9,979)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	53	(24,955)	(9,922)	(15,033)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	85	(40,205)	(15,848)	(24,357)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	85	(40,205)	(15,785)	(24,420)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	250	(118,766)	(47,785)	(70,981)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	328	(155,735)	(60,635)	(95,100)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	338	(160,819)	(62,201)	(98,618)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	486	(231,061)	(114,842)	(116,219)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,328	(1,106,321)	(323,394)	(782,927)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	150	(42,195)	(12,330)	(29,865)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	300	(84,390)	(33,318)	(51,072)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	460	(129,398)	(53,541)	(75,857)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	64	(30,500)	(30,622)	122
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	198	(94,273)	(89,326)	(4,947)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	198	(94,273)	(82,546)	(11,727)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	198	(94,273)	(82,063)	(12,210)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	198	(94,273)	(81,580)	(12,693)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	197	(93,811)	(80,700)	(13,111)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	972	(462,123)	(198,556)	(263,567)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,945	(924,245)	(318,084)	(606,161)
Insgesamt				<u>\$ (10,472,994)</u>	<u>\$ (1,009,117)</u>	<u>\$ (9,463,877)</u>
					Wertsteigerung	\$ 636,470
					Wertminderung	\$ (10,100,347)

INFLATIONSSWAPS

Kontrahent	Nomineller Betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Bank of America, NA.	USD 6,510	01/05/2023	2.163%	CPI#	<u>\$ 102,329</u>

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					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
IBOVESPA Futures	51	0.00%	BRL 6,134	06/16/2021	\$ (52,765)
KOSPI 200 Futures	4,250,000	0.00%	KRW 1,822,922	06/10/2021	9,804
KOSPI 200 Futures	8,500,000	0.00%	3,544,615	06/10/2021	(71,156)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation erhalten					
Goldman Sachs International					
IBXXC1D1	1,000,000	3 Month LIBOR	USD 1,000	06/20/2021	24,798
IBXXC2D1	1,510,000	3 Month EURIBOR	EUR 1,510	06/20/2021	47,467
Morgan Stanley Capital Services LLC					
RTS Futures	24	0.00%	USD 3,535	06/17/2021	292,610
RTS Futures	8	0.00%	1,269	06/17/2021	75,918
Insgesamt					\$ 326,676
				Wertsteigerung	\$ 450,597
				Wertminderung	\$ (123,921)
Swaps insgesamt					\$ (13,680,413)

- (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) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für Derivate zu dienen.
- (e) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. Mai 2021.
- (f) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (g) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (h) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (i) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (j) Tagesgeld.
- (k) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.

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
 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
 INR – Indian Rupee
 JPY – Japanese Yen
 MXN – Mexican Peso
 MYR – Malaysian Ringgit
 NOK – Norwegian Krone
 NZD – New Zealand Dollar
 PEN – Peruvian Sol
 PHP – Philippine Peso
 PLN – Polish Zloty

RUB	– Russian Ruble
SEK	– Swedish Krona
SGD	– Singapore Dollar
THB	– Thailand Baht
TWD	– New Taiwan Dollar
USD	– United States Dollar
ZAR	– South African Rand

Glossar:

ABS	– Asset-Backed Securities
ADR	– American Depositary Receipt
BBSW	– Bank Bill Swap Reference Rate (Australia)
BIST	– Borsa Istanbul Stock Exchange
BKBM	– Bank Bill Benchmark (New Zealand)
CBT	– Chicago Board of Trade
CDOR	– Canadian Dealer Offered Rate
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
CPI	– Consumer Price Index
ETF	– Exchange Traded Fund
ETS	– Emission Trading Scheme
EURIBOR	– Euro Interbank Offered Rate
FTSE	– Financial Times Stock Exchange
INTRCONX	– Inter-Continental Exchange
JSE	– Johannesburg Stock Exchange
KLCI	– Kuala Lumpur Composite Index
KOSPI	– Korea Composite Stock Price Index
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
REG	– Registered Shares
REIT	– Real Estate Investment Trust
REMICs	– Real Estate Mortgage Investment Conduits
RTS	– Russian Trading System
SGX	– Singapore Exchange
SPI	– Share Price Index
STIBOR	– Stockholm Interbank Offered Rate
TOPIX	– Tokyo Price Index
TSX	– Toronto Stock Exchange
UCITS	– Undertaking for Collective Investment in Transferable Securities
WIG	– Warszawski Indeks Gieldowy

	Anteile	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
FINANZWERT			
BANKEN			
Bank of Hangzhou Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	512,200	¥ 8,461,544	0.4%
Bank of Hangzhou Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	664,800	11,001,403	0.6
Bank of Nanjing Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	1,591,600	16,711,800	0.8
Bank of Nanjing Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	2,036,300	21,417,958	1.1
Bank of Ningbo Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	226,500	9,580,950	0.5
Bank of Ningbo Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	288,200	12,211,847	0.6
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	458,100	26,656,839	1.3
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	586,000	34,158,043	1.7
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	622,500	14,385,975	0.7
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	791,900	18,332,314	0.9
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	652,000	15,778,400	0.8
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	830,300	20,127,851	1.0
Shanghai Pudong Development Bank Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	1,191,400	12,235,678	0.6
Shanghai Pudong Development Bank Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	1,521,300	15,650,648	0.8
		<u>236,711,250</u>	<u>11.8</u>
KAPITALMÄRKTE			
CITIC Securities Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	376,000	9,817,360	0.5
CITIC Securities Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	486,456	12,723,232	0.6
GF Securities Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	926,700	14,827,200	0.7
GF Securities Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	1,185,300	18,997,449	1.0
Guotai Junan Securities Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	643,400	11,516,860	0.6
Guotai Junan Securities Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	819,700	14,697,889	0.7
Hithink RoyalFlush Information Network Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	79,600	9,504,240	0.5
Hithink RoyalFlush Information Network Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	103,800	12,415,056	0.6
Huatai Securities Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	720,400	12,369,268	0.6
Huatai Securities Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	915,172	15,740,555	0.8
		<u>132,609,109</u>	<u>6.6</u>
VERSICHERUNGEN			
Ping An Insurance Group Co. of China, Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	375,877	26,987,969	1.4
Ping An Insurance Group Co. of China, Ltd. - Class A (Shanghai)	481,423	34,625,678	1.7
		<u>61,613,647</u>	<u>3.1</u>
		<u>430,934,006</u>	<u>21.5</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Hengyi Petrochemical Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	341,100	4,260,339	0.2
Hengyi Petrochemical Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	446,700	5,588,888	0.3
Kingfa Sci & Tech Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	166,800	3,763,008	0.2
Kingfa Sci & Tech Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	216,800	4,899,428	0.3
Luxi Chemical Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	647,700	10,544,556	0.5
Luxi Chemical Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	840,600	13,708,527	0.7
Ningxia Baofeng Energy Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	342,100	4,869,610	0.2
Ningxia Baofeng Energy Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	262,100	3,724,441	0.2
Shanghai Putailai New Energy Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	55,980	5,811,843	0.3
Shanghai Putailai New Energy Technology Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	73,080	7,600,227	0.4
Sinoma Science & Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	206,200	4,643,624	0.2
Sinoma Science & Technology Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	265,900	5,998,377	0.3
Wanhua Chemical Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	71,500	7,777,770	0.4
Wanhua Chemical Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	90,700	9,883,331	0.5
Zhejiang Runtu Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	650,700	6,298,776	0.3
Zhejiang Runtu Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	848,217	8,224,876	0.4
		<u>107,597,621</u>	<u>5.4</u>
BAUMATERIAL			
Gansu Shangfeng Cement Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	239,800	4,835,484	0.2
Gansu Shangfeng Cement Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	185,400	3,732,102	0.2
Tangshan Jidong Cement Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	444,600	6,255,522	0.3
Tangshan Jidong Cement Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	579,900	8,173,240	0.4
		<u>22,996,348</u>	<u>1.1</u>
METALL UND BERGBAU			
Aluminum Corp. of China, Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	1,040,900	5,443,907	0.3
Aluminum Corp. of China, Ltd. - Class A (Shanghai)	1,352,500	7,085,752	0.4
Baoshan Iron & Steel Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	2,806,948	22,118,750	1.1
Baoshan Iron & Steel Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	3,591,200	28,347,373	1.4
Ganfeng Lithium Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	74,800	9,656,680	0.5
Ganfeng Lithium Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	94,500	12,220,953	0.6
Hunan Valin Steel Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	855,800	5,819,440	0.3
Hunan Valin Steel Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	1,112,100	7,575,299	0.4

	Anteile	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
Shandong Nanshan Aluminum Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	6,087,800	¥ 24,472,956	1.2%
Shandong Nanshan Aluminum Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	7,780,500	31,331,455	1.6
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	1,684,150	18,913,005	0.9
Zijin Mining Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	2,148,300	24,166,942	1.2
		<u>197,152,512</u>	<u>9.9</u>
PAPIER- UND HOLZPRODUKTE			
Shandong Chenming Paper Holdings, Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	1,404,700	14,398,175	0.7
Shandong Chenming Paper Holdings, Ltd. - Class A (Shenzhen)	1,789,800	18,377,032	0.9
		<u>32,775,207</u>	<u>1.6</u>
		<u>360,521,688</u>	<u>18.0</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Anhui Kouzi Distillery Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	105,500	7,084,325	0.3
Anhui Kouzi Distillery Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	137,500	9,249,020	0.5
Anhui Yingjia Distillery Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	308,900	13,129,191	0.6
Anhui Yingjia Distillery Co., Ltd. Class A (Nth SSE-SEHK)	243,355	10,325,553	0.5
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	18,044	40,021,592	2.0
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	23,139	51,410,655	2.6
Luzhou Laojiao Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	55,800	15,342,210	0.8
Luzhou Laojiao Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	71,100	19,582,599	1.0
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	95,000	9,969,300	0.5
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	121,018	12,721,492	0.6
Wuliangye Yibin Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	25,026	7,886,193	0.4
Wuliangye Yibin Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	32,531	10,268,816	0.5
		<u>206,990,946</u>	<u>10.3</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Yixintang Pharmaceutical Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	277,500	10,883,550	0.5
Yixintang Pharmaceutical Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	352,700	13,856,708	0.7
		<u>24,740,258</u>	<u>1.2</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Meihua Holdings Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	3,211,300	20,523,365	1.0
Tongwei Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	163,500	6,561,255	0.4
Tongwei Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	211,800	8,514,166	0.4
		<u>35,598,786</u>	<u>1.8</u>
TABAK			
Shanghai Bairun Investment Holding Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	33,200	4,096,880	0.2
Shanghai Bairun Investment Holding Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	42,800	5,290,612	0.3
		<u>9,387,492</u>	<u>0.5</u>
		<u>276,717,482</u>	<u>13.8</u>
INDUSTRIEGÜTER			
FLUGGESELLSCHAFTEN			
Air China, Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	516,600	4,344,606	0.2
Air China, Ltd. - Class A (Shanghai)	669,800	5,642,715	0.3
		<u>9,987,321</u>	<u>0.5</u>
BAUPRODUKTE			
Zhuzhou Kibing Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	555,900	9,361,356	0.5
Zhuzhou Kibing Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	748,600	12,628,126	0.6
		<u>21,989,482</u>	<u>1.1</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	63,900	27,738,990	1.4
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	81,600	35,483,541	1.8
Jiangsu Zhongtian Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	757,500	8,029,500	0.4
Jiangsu Zhongtian Technology Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	991,800	10,531,179	0.5
NARI Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	134,500	4,184,295	0.2
NARI Technology Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	174,800	5,447,390	0.3
TBEA Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	342,100	4,081,253	0.2
TBEA Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	447,100	5,343,085	0.2
		<u>100,839,233</u>	<u>5.0</u>
MASCHINEN			
Sany Heavy Industry Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	228,940	6,934,593	0.3
Sany Heavy Industry Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	295,600	8,969,138	0.5
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	2,370,708	25,485,111	1.3
Zoomlion Heavy Industry Science and Technology Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	3,032,600	32,656,573	1.6
		<u>74,045,415</u>	<u>3.7</u>
STRASSE UND SCHIENE			
Daqin Railway Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	967,600	6,628,060	0.4
Daqin Railway Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	1,219,700	8,369,328	0.4
		<u>14,997,388</u>	<u>0.8</u>

	Anteile	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
TRANSPORTWESEN – INFRASTRUKTUR			
Shandong Hi-speed Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	1,882,500	¥ 11,972,700	0.6%
Shandong Hi-speed Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	2,392,700	15,243,770	0.8
TangShan Port Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	3,367,400	8,230,601	0.4
TangShan Port Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	2,666,800	6,506,992	0.3
		<u>41,954,063</u>	<u>2.1</u>
		<u>263,812,902</u>	<u>13.2</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
BOE Technology Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	2,812,400	17,774,368	0.9
BOE Technology Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	3,598,600	22,782,305	1.1
GoerTek, Inc. - Class A (Nth SZ-SEHK)	238,200	9,277,890	0.5
GoerTek, Inc. - Class A (Shenzhen)	309,691	12,083,230	0.6
Hengdian Group DMEGC Magnetics Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	447,800	6,094,558	0.3
Hengdian Group DMEGC Magnetics Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	562,900	7,674,258	0.4
Lens Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	169,900	4,957,682	0.3
Lens Technology Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	222,300	6,497,881	0.3
Luxshare Precision Industry Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	330,383	12,884,937	0.7
Luxshare Precision Industry Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	420,160	16,414,450	0.8
Shengyi Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	468,300	10,728,753	0.5
Shengyi Technology Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	596,505	13,689,456	0.7
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	85,600	8,200,480	0.4
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	111,500	10,700,089	0.5
		<u>159,760,337</u>	<u>8.0</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Hangzhou First Applied Material Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	95,400	7,784,640	0.4
Hangzhou First Applied Material Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	120,360	9,838,284	0.5
JCET Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	159,500	5,526,675	0.3
JCET Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	210,202	7,296,038	0.4
LONGi Green Energy Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	83,751	8,550,977	0.4
LONGi Green Energy Technology Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	105,800	10,820,776	0.5
		<u>49,817,390</u>	<u>2.5</u>
SOFTWARE			
Thunder Software Technology Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	58,500	8,828,820	0.4
Thunder Software Technology Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	74,000	11,187,306	0.6
		<u>20,016,126</u>	<u>1.0</u>
		<u>229,593,853</u>	<u>11.5</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Huayu Automotive Systems Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	146,700	3,598,551	0.2
Huayu Automotive Systems Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	190,700	4,685,924	0.2
		<u>8,284,475</u>	<u>0.4</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	261,385	9,668,631	0.5
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	338,500	12,542,671	0.6
		<u>22,211,302</u>	<u>1.1</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Shenzhen Overseas Chinese Town Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	831,000	6,930,540	0.3
Shenzhen Overseas Chinese Town Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	1,077,000	8,997,643	0.5
		<u>15,928,183</u>	<u>0.8</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Haier Smart Home Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	337,200	10,190,838	0.5
Haier Smart Home Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	261,100	7,877,387	0.4
Hisense Home Appliances Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	613,900	8,929,173	0.5
Hisense Home Appliances Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	469,478	6,816,821	0.3
TCL Technology Group Corp. - Class A (Nth SZ-SEHK)	2,588,400	20,914,272	1.1
TCL Technology Group Corp. - Class A (Shenzhen)	3,312,900	26,814,314	1.3
		<u>81,542,805</u>	<u>4.1</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
China Tourism Group Duty Free Corp., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	63,300	21,173,850	1.1
China Tourism Group Duty Free Corp., Ltd. - Class A (Shanghai)	80,564	26,995,051	1.4
Shanghai Yuyuan Tourist Mart Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)	686,500	9,823,815	0.5
Shanghai Yuyuan Tourist Mart Co., Ltd. - Class A (Shanghai)	888,000	12,729,156	0.6
		<u>70,721,872</u>	<u>3.6</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Zhejiang Semir Garment Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)	823,600	9,858,492	0.5
Zhejiang Semir Garment Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)	1,047,800	12,563,758	0.6
		<u>22,422,250</u>	<u>1.1</u>
		<u>221,110,887</u>	<u>11.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (CNH)	Nettover- mögen %
GESUNDHEITSWESEN					
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF					
Jafron Biomedical Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)			77,300	¥ 6,679,493	0.4%
Jafron Biomedical Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)			98,600	8,534,694	0.4
				<u>15,214,187</u>	<u>0.8</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN					
Aier Eye Hospital Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK) . .			91,800	7,698,348	0.4
Aier Eye Hospital Group Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)			116,000	9,744,507	0.5
Jointown Pharmaceutical Group Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)			418,410	7,175,731	0.3
Jointown Pharmaceutical Group Co., Ltd. - Class A (Shanghai)			542,600	9,321,610	0.5
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)			356,303	8,280,482	0.4
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class A (Shanghai)			461,617	10,746,447	0.5
				<u>52,967,125</u>	<u>2.6</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN					
Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)			39,000	6,824,610	0.4
Hangzhou Tigermed Consulting Co., Ltd. - Class A (Shenzhen)			49,100	8,606,800	0.4
				<u>15,431,410</u>	<u>0.8</u>
PHARMAZEUTIKA					
Jiangsu Hengrui Medicine Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)			52,600	4,539,380	0.2
Jiangsu Hengrui Medicine Co., Ltd. - Class A (Shanghai)			65,728	5,682,092	0.3
Joincare Pharmaceutical Group Industry Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)			578,100	8,509,632	0.4
Joincare Pharmaceutical Group Industry Co., Ltd. - Class A (Shanghai)			732,510	10,801,110	0.5
Livzon Pharmaceutical Group, Inc. - Class A (Nth SZ-SEHK)			240,342	11,957,014	0.6
Livzon Pharmaceutical Group, Inc. - Class A (Shenzhen)			306,099	15,254,641	0.8
Yunnan Baiyao Group Co. Ltd - Class A (Shenzhen)			46,900	5,900,781	0.3
Yunnan Baiyao Group Co., Ltd. - Class A (Nth SZ-SEHK)			36,300	4,559,280	0.2
Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co., Ltd. - Class A (Nth SSE-SEHK)			120,700	5,353,045	0.3
Zhejiang Jiuzhou Pharmaceutical Co., Ltd. - Class A (Shanghai)			156,000	6,930,511	0.4
				<u>79,487,486</u>	<u>4.0</u>
				<u>163,100,208</u>	<u>8.2</u>
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Gemdale Corp. - Class A (Nth SSE-SEHK)			550,483	5,912,187	0.3
Gemdale Corp. - Class A (Shanghai)			718,200	7,726,747	0.4
				<u>13,638,934</u>	<u>0.7</u>
Gesamtanlagen				¥ 1,959,429,960	98.0%
Termineinlagen					
SEB, Stockholm(a)	0.01 %	—		89,184	0.0
Sumitomo, Tokyo(a)	(0.78)%	—		81,755	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>170,939</u>	<u>0.0</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>39,977,606</u>	<u>2.0</u>
Nettovermögen				<u>¥ 1,999,578,505</u>	<u>100.0%</u>

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	AUD	0*	CNH	1	06/21/2021	¥ 11
Brown Brothers Harriman & Co.+	CAD	0*	CNH	1	06/21/2021	6
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	94	AUD	19	06/21/2021	(1,744)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	88	CAD	16	06/21/2021	(1,153)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	180	HKD	217	06/21/2021	(1,619)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	88	NZD	19	06/21/2021	(751)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	180	SGD	37	06/21/2021	(914)
Brown Brothers Harriman & Co.+	CNH	9,269	USD	1,439	06/21/2021	(88,283)
Brown Brothers Harriman & Co.+	HKD	5	CNH	4	06/21/2021	27

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	NZD	0*	CNH	1 06/21/2021 ¥ 3
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	SGD	1	CNH	4 06/21/2021 14
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	19	CNH	125 06/21/2021 701
				¥ (93,702)
			Wertsteigerung	¥ 762
			Wertminderung	¥ (94,464)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

* Die Anzahl der Kontrakte beträgt weniger als 500.

(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 GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Abanca Corp. Bancaria SA(a)	7.50%	10/02/2023	EUR 4,800	\$ 6,330,311	3.1%
AIB Group PLC(a)	6.25%	06/23/2025	1,095	1,508,034	0.7
Ally Financial, Inc., Series B(a)	4.70%	05/15/2026	USD 10,000	10,272,715	5.0
Banca Monte dei Paschi di Siena SpA	5.38%	01/18/2028	EUR 6,445	7,079,835	3.4
Banco BPM SpA(a)	8.75%	06/18/2024	1,470	2,043,615	1.0
Bankinter SA(a)	6.25%	01/17/2026	5,200	7,159,238	3.5
BAWAG Group AG(a)	5.00%	05/14/2025	3,400	4,455,580	2.2
CaixaBank SA(a)	5.88%	10/09/2027	7,200	10,035,908	4.9
Commerzbank AG(a)	6.13%	10/09/2025	6,200	8,223,173	4.0
Credit Suisse Group AG(a)	5.25%	02/11/2027	USD 3,615	3,778,765	1.8
Credit Suisse Group AG(a)	6.38%	08/21/2026	6,349	6,939,767	3.4
Deutsche Bank AG(a)	4.63%	10/30/2027	EUR 4,000	5,004,010	2.4
Deutsche Bank AG(a)	4.79%	04/30/2025	USD 5,800	5,788,778	2.8
Deutsche Bank AG(a)	7.50%	04/30/2025	2,800	3,101,820	1.5
Intesa Sanpaolo SpA(a)	3.75%	02/27/2025	EUR 6,550	7,807,576	3.8
Jyske Bank A/S(a)	3.62%	12/04/2169	5,000	6,132,686	3.0
Raiffeisen Bank International AG(a)	6.00%	06/15/2026	3,200	4,240,273	2.1
Virgin Money UK PLC(a)	8.00%	12/08/2022	GBP 3,545	5,370,449	2.6
				<u>105,272,533</u>	<u>51.2</u>
VERSICHERUNGEN					
UnipolSai Assicurazioni SpA(a)	6.38%	04/27/2030	EUR 4,550	6,152,054	3.0
				<u>111,424,587</u>	<u>54.2</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Citigroup, Inc.(a)	3.88%	02/18/2026	USD 2,493	2,512,416	1.2
Citigroup, Inc., Series P(a)	5.95%	05/15/2025	2,250	2,463,750	1.2
Citigroup, Inc., Series U(a)	5.00%	09/12/2024	1,800	1,882,241	0.9
Coöperatieve Rabobank UA(a)	4.38%	06/29/2027	EUR 5,000	6,705,283	3.3
Danske Bank A/S(a)	4.38%	11/18/2169	USD 6,000	6,016,360	2.9
Erste Group Bank AG(a)	4.25%	10/15/2027	EUR 3,400	4,410,549	2.1
HSBC Bank PLC, Series 1M(a) (b)	0.75%	06/30/2021	USD 2,000	1,868,295	0.9
HSBC Bank PLC, Series 2M(a) (b)	0.75%	09/30/2021	2,000	1,869,196	0.9
HSBC Holdings PLC(a)	6.38%	09/17/2024	3,525	3,859,875	1.9
HSBC Holdings PLC(a)	6.38%	03/30/2025	6,412	7,101,290	3.5
JPMorgan Chase & Co., Series Q(a)	5.15%	05/01/2023	8,310	8,550,009	4.2
JPMorgan Chase & Co., Series U(a)	6.13%	04/30/2024	1,395	1,508,807	0.7
KBC Group NV(a)	4.25%	10/24/2025	EUR 4,000	5,157,729	2.5
Natwest Group PLC(a)	5.13%	05/12/2027	GBP 6,765	10,220,522	5.0
UBS Group AG(a)	5.00%	01/31/2023	USD 11,455	11,669,781	5.7
Wells Fargo & Co.(a)	3.90%	03/15/2026	5,701	5,846,936	2.8
				<u>81,643,039</u>	<u>39.7</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco do Brasil SA/Cayman(a)	9.00%	06/18/2024	5,415	5,999,820	3.0
Bank of East Asia Ltd. (The)(a)	5.83%	10/21/2025	5,400	5,793,188	2.8
				<u>11,793,008</u>	<u>5.8</u>
GEKAUFTE OPTIONEN – KAUFPTIONEN					
OPTIONEN AUF FONDS UND INVESTMENTVERMÖGEN					
S&P 500 Index					
Expiration: Jul 2021, Exercise Price: USD 100.00(c)			50,050	172,728	0.1
Gesamtanlagen				<u>\$ 205,033,362</u>	<u>99.8%</u>
(Kosten \$193,054,592)					
Termineinlagen					
Nordea Bank Abp, Oslo(d)	(0.78)%	—		21,010	0.0
SEB, Stockholm(d)	0.01 %	—		60,934	0.0
Sumitomo, London(d)	0.01 %	—		121	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>82,065</u>	<u>0.0</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>377,465</u>	<u>0.2</u>
Nettovermögen				<u>\$ 205,492,892</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Barclays Bank PLC	GBP	3,496	USD	4,821	06/17/2021	\$ (141,088)
BNP Paribas SA	GBP	10,372	USD	14,289	06/17/2021	(431,173)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	20,983	USD	24,715	06/14/2021	(878,165)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP	446	USD	618	06/17/2021	(15,493)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	26,731	USD	32,726	06/30/2021	112,126
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	310	EUR	253	08/03/2021	(1,068)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	38,923	EUR	31,857	06/21/2021	(61,328)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	27	CHF	24	06/30/2021	(80)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	42	GBP	29	06/30/2021	133
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	4,713	GBP	3,344	06/17/2021	33,111
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	26,731	USD	32,738	07/15/2021	113,248
						<u>\$ (1,269,777)</u>
					Wertsteigerung	\$ 258,618
					Wertminderung	\$ (1,528,395)

+ 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 2021.
- (c) Ein Kontrakt bezieht sich auf 1 Anteil.
- (d) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Amadeus IT Group SA - Class A	18,950	\$ 1,429,898	1.2%
Automatic Data Processing, Inc.	9,430	1,848,469	1.5
Capgemini SE	7,780	1,454,625	1.2
Fidelity National Information Services, Inc.	7,391	1,101,111	0.9
Genpact Ltd.	13,430	614,288	0.5
Mastercard, Inc. - Class A	3,110	1,121,404	0.9
Nomura Research Institute Ltd.	15,000	477,911	0.4
Paychex, Inc.	22,952	2,321,365	1.9
Visa, Inc. - Class A	5,380	1,222,874	1.0
		<u>11,591,945</u>	<u>9.5</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Broadcom, Inc.	1,186	560,184	0.4
KLA Corp.	1,920	608,429	0.5
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd. (Sponsored ADR)	12,201	1,431,909	1.2
Texas Instruments, Inc.	8,366	1,588,034	1.3
		<u>4,188,556</u>	<u>3.4</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	940	474,305	0.4
Citrix Systems, Inc.	12,482	1,434,931	1.2
Constellation Software, Inc./Canada	1,040	1,492,683	1.2
Microsoft Corp. (a)	19,890	4,966,135	4.1
NortonLifeLock, Inc.	22,150	612,669	0.5
Oracle Corp.	30,893	2,432,515	2.0
Oracle Corp. Japan	5,800	524,529	0.4
		<u>11,937,767</u>	<u>9.8</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc. (a)	20,780	2,589,396	2.1
Logitech International SA	5,723	703,803	0.6
		<u>3,293,199</u>	<u>2.7</u>
		<u>31,011,467</u>	<u>25.4</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	146,592	1,176,375	1.0
Bank of America Corp.	10,483	444,374	0.4
DBS Group Holdings Ltd.	43,200	992,590	0.8
JPMorgan Chase & Co.	8,140	1,336,914	1.1
KBC Group NV	7,960	651,636	0.5
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	115,600	663,907	0.5
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	51,500	486,491	0.4
Royal Bank of Canada	18,558	1,929,768	1.6
Toronto-Dominion Bank (The)	14,517	1,046,310	0.8
US Bancorp	15,400	936,012	0.8
		<u>9,664,377</u>	<u>7.9</u>
KAPITALMÄRKTE			
CME Group, Inc. - Class A	8,730	1,909,775	1.6
Partners Group Holding AG	1,022	1,542,562	1.2
S&P Global, Inc.	3,551	1,347,498	1.1
Singapore Exchange Ltd.	73,600	577,723	0.5
T. Rowe Price Group, Inc.	5,266	1,007,649	0.8
		<u>6,385,207</u>	<u>5.2</u>
VERSICHERUNGEN			
Allianz SE (REG)	2,320	616,103	0.5
Progressive Corp. (The)	4,100	406,228	0.3
RenaissanceRe Holdings Ltd.	97	14,949	0.0
Sampo Oyj - Class A	14,440	687,756	0.6
Zurich Insurance Group AG	1,280	538,369	0.5
		<u>2,263,405</u>	<u>1.9</u>
		<u>18,312,989</u>	<u>15.0</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	48,470	1,568,053	1.3
Compass Group PLC	56,304	1,283,478	1.0
McDonald's Corp.	2,419	565,780	0.5
		<u>3,417,311</u>	<u>2.8</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Garmin Ltd.	6,373	\$ 906,495	0.8%
Sony Group Corp.	12,400	1,233,014	1.0
		<u>2,139,509</u>	<u>1.8</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Amazon.com, Inc.	850	2,739,610	2.2
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Dollar General Corp.	2,401	487,307	0.4
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	1,612	2,267,439	1.9
Home Depot, Inc. (The)	7,394	2,358,021	1.9
O'Reilly Automotive, Inc.	1,290	690,305	0.6
Ross Stores, Inc.	7,173	906,595	0.7
		<u>6,222,360</u>	<u>5.1</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Deckers Outdoor Corp.	4,649	1,559,461	1.3
		<u>16,565,558</u>	<u>13.6</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Comcast Corp. - Class A	19,240	1,103,222	0.9
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	67,300	1,822,503	1.5
		<u>2,925,725</u>	<u>2.4</u>
UNTERHALTUNG			
Activision Blizzard, Inc.	13,370	1,300,232	1.1
Electronic Arts, Inc.	5,780	826,135	0.7
Ubisoft Entertainment SA	5,860	426,234	0.3
		<u>2,552,601</u>	<u>2.1</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class C	1,386	3,342,422	2.7
Auto Trader Group PLC	148,796	1,184,035	1.0
Facebook, Inc. - Class A	7,223	2,374,417	2.0
Kakaku.com, Inc.	26,000	773,837	0.6
		<u>7,674,711</u>	<u>6.3</u>
		<u>13,153,037</u>	<u>10.8</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Coca-Cola Co. (The)	16,280	900,121	0.7
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	54,342	1,582,023	1.3
Walmart, Inc. (a)	12,300	1,746,969	1.4
		<u>3,328,992</u>	<u>2.7</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Morinaga & Co., Ltd./Japan	14,800	459,794	0.4
Nestle SA (REG)	6,770	836,218	0.7
Salmar ASA	26,240	1,937,238	1.6
		<u>3,233,250</u>	<u>2.7</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The) (a)	10,950	1,476,607	1.2
TABAK			
Philip Morris International, Inc. (a)	12,280	1,184,160	1.0
Swedish Match AB	206,500	1,914,497	1.6
		<u>3,098,657</u>	<u>2.6</u>
		<u>12,037,627</u>	<u>9.9</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Medtronic PLC	4,600	582,314	0.5
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Anthem, Inc.	3,885	1,547,085	1.3
UnitedHealth Group, Inc. (a)	6,120	2,520,950	2.0
		<u>4,068,035</u>	<u>3.3</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Thermo Fisher Scientific, Inc.	1,080	507,060	0.4

AB SICAV I
Low Volatility Total Return Equity Portfolio

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PHARMAZEUTIKA					
Eli Lilly & Co.			3,100	\$ 619,194	0.5%
Johnson & Johnson			3,640	616,070	0.5
Merck & Co., Inc.			14,435	1,095,472	0.9
Novo Nordisk A/S - Class B			17,110	1,350,765	1.1
Roche Holding AG			8,211	2,874,275	2.4
				<u>6,555,776</u>	<u>5.4</u>
				<u>11,713,185</u>	<u>9.6</u>
INDUSTRIEGÜTER					
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG					
L3Harris Technologies, Inc.			3,900	850,434	0.7
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG					
Generac Holdings, Inc.			1,781	585,451	0.5
Regal Beloit Corp.			5,874	835,459	0.7
Schneider Electric SE (Paris)			5,750	915,168	0.7
				<u>2,336,078</u>	<u>1.9</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN					
Booz Allen Hamilton Holding Corp.			12,860	1,092,200	0.9
RELX PLC			61,845	1,620,506	1.3
Wolters Kluwer NV			12,677	1,217,460	1.0
				<u>3,930,166</u>	<u>3.2</u>
				<u>7,116,678</u>	<u>5.8</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGBETRIEBE					
Enel SpA			150,500	1,492,555	1.2
NextEra Energy, Inc.			15,680	1,148,089	1.0
				<u>2,640,644</u>	<u>2.2</u>
MEHRFACH-VERSORGBETRIEBE					
Ameren Corp.			10,450	879,890	0.7
Dominion Energy, Inc.			8,100	616,734	0.5
				<u>1,496,624</u>	<u>1.2</u>
				<u>4,137,268</u>	<u>3.4</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
Akzo Nobel NV			7,638	975,177	0.8
Johnson Matthey PLC			18,740	808,400	0.7
				<u>1,783,577</u>	<u>1.5</u>
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
American Campus Communities, Inc.			8,220	387,655	0.3
Nippon Building Fund, Inc.			92	588,226	0.5
				<u>975,881</u>	<u>0.8</u>
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Vonovia SE			8,440	529,773	0.4
				<u>1,505,654</u>	<u>1.2</u>
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Royal Dutch Shell PLC - Class B			79,737	1,449,718	1.2
Gesamtanlagen				<u>\$ 118,786,758</u>	<u>97.4%</u>
(Kosten \$95,488,648)					
Termineinlagen					
Bank of Nova Scotia, Toronto(b)	0.01 %	—		12,350	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	(1.44)%	—		12,287	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.53)%	—		12,741	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.29)%	—		15,494	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.13)%	—		12,430	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.00 %	—		16,683	0.0
Citibank, New York(b)	0.01 %	—		1,412,954	1.2
DnB Bank ASA, Oslo(b)	(0.78)%	—		10,208	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	—		38,301	0.1
Nordea Bank Abp, Oslo(b)	(0.13)%	—		12,115	0.0
SEB, Stockholm(b)	(0.28)%	—		12,629	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	—		12,449	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>1,580,641</u>	<u>1.3</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>1,599,417</u>	<u>1.3</u>
Nettovermögen				<u>\$ 121,966,816</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Short					
MSCI EAFE Futures	06/18/2021	269	\$ 29,792,359	\$ 31,432,650	\$ (1,640,291)
S&P 500 E-Mini Futures	06/18/2021	322	62,745,430	67,660,250	(4,914,820)
S&P/TSX 60 Index Futures	06/17/2021	16	2,927,263	3,146,360	(219,097)
					<u>\$ (6,774,208)</u>

DEVEISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Barclays Bank PLC	GBP	1,081	USD	1,522	06/15/2021	\$ (11,916)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	519	USD	428	06/15/2021	(1,805)
Brown Brothers Harriman & Co.	DKK	1,772	USD	288	06/15/2021	(2,750)
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS	2,093	USD	639	06/15/2021	(5,037)
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK	4,938	USD	588	06/15/2021	(6,256)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	185	EUR	151	06/15/2021	(638)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	196	JPY	21,267	06/15/2021	(2,035)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD	687	AUD	880	06/07/2021	(8,431)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD	1,737	SGD	2,307	06/07/2021	7,935
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD	20	EUR	17	06/21/2021	(32)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD	33	CAD	40	06/30/2021	95
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD	623	GBP	441	06/30/2021	1,984
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD	96,931	JPY	10,556,692	06/30/2021	(795,932)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD	21	NZD	28	06/30/2021	(154)
Brown Brothers Harriman & Co. +	USD	9,820	PLN	36,129	06/30/2021	8,884
Deutsche Bank AG	NOK	12,713	USD	1,534	06/15/2021	13,785
Goldman Sachs Bank USA	SGD	1,700	USD	1,275	06/15/2021	(10,840)
Goldman Sachs Bank USA	USD	1,141	HKD	8,864	06/15/2021	761
HSBC Bank USA	CAD	4,451	USD	3,681	06/15/2021	(3,071)
JPMorgan Chase Bank, NA	CHF	2,846	USD	3,153	06/15/2021	(12,097)
UBS AG	EUR	1,279	USD	1,551	06/15/2021	(9,809)
UBS AG	USD	865	AUD	1,114	06/15/2021	(6,034)
UBS AG	USD	884	JPY	96,560	06/15/2021	(4,311)
						<u>\$ (847,704)</u>
					Wertsteigerung	\$ 33,444
					Wertminderung	\$ (881,148)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD – Australian Dollar
CAD – Canadian Dollar
CHF – Swiss Franc
DKK – Danish Krone
EUR – Euro
GBP – Great British Pound
HKD – Hong Kong Dollar
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

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
EAFE – Europe, Australia, and Far East
MSCI – Morgan Stanley Capital International

REG – Registered Shares
REIT – Real Estate Investment Trust
TSX – Toronto Stock Exchange

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Arkema SA	0.13%	10/14/2026	EUR 200	€ 200,931	0.7%
Ecolab, Inc.	5.50%	12/08/2041	USD 110	121,951	0.4
Sociedad Quimica y Minera de Chile SA	3.63%	04/03/2023	215	183,945	0.6
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	248	210,949	0.7
				<u>717,776</u>	<u>2.4</u>
INVESTITIONSGÜTER					
CNH Industrial Capital LLC	1.45%	07/15/2026	365	298,876	1.0
Ingersoll-Rand Global Holding Co., Ltd.	5.75%	06/15/2043	85	97,483	0.3
Republic Services, Inc.	1.75%	02/15/2032	270	207,223	0.7
Siemens Financieringsmaatschappij NV	1.20%	03/11/2026	360	295,334	1.0
Signify NV	2.38%	05/11/2027	EUR 100	110,329	0.4
Waste Management, Inc.	2.95%	06/01/2041	USD 370	302,300	1.0
Xylem, Inc./NY	1.95%	01/30/2028	225	186,382	0.6
				<u>1,497,927</u>	<u>5.0</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Tencent Holdings Ltd.	2.39%	06/03/2030	375	303,455	1.0
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc., Series B(a)	2.88%	03/02/2025	EUR 300	303,000	1.0
Orange SA(a)	1.75%	12/19/2026	200	204,180	0.7
Verizon Communications, Inc.	3.40%	03/22/2041	USD 360	301,326	1.0
Verizon Communications, Inc.	3.88%	02/08/2029	375	347,179	1.1
Vodafone Group PLC	4.25%	09/17/2050	57	51,919	0.2
				<u>1,207,604</u>	<u>4.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Daimler AG	0.75%	09/10/2030	EUR 116	118,061	0.4
General Motors Co.	5.00%	10/01/2028	USD 190	181,560	0.6
General Motors Financial Co., Inc.	2.40%	04/10/2028	360	299,132	1.0
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027	165	149,242	0.5
Volkswagen International Finance NV	0.88%	09/22/2028	EUR 200	206,042	0.7
Volkswagen International Finance NV(a)	2.70%	12/14/2022	100	102,763	0.3
				<u>1,056,800</u>	<u>3.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
HOCHTIEF AG	0.63%	04/26/2029	165	161,092	0.6
Owens Corning	3.95%	08/15/2029	USD 200	183,246	0.6
				<u>344,338</u>	<u>1.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Lowe's Cos., Inc.	3.70%	04/15/2046	90	78,598	0.3
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Abbott Laboratories	4.75%	11/30/2036	45	46,509	0.2
AbbVie, Inc.	2.95%	11/21/2026	50	44,054	0.2
AbbVie, Inc.	4.05%	11/21/2039	130	119,910	0.4
AbbVie, Inc.	4.88%	11/14/2048	130	133,651	0.4
Amgen, Inc.	4.40%	05/01/2045	65	62,292	0.2
AstraZeneca PLC	6.45%	09/15/2037	150	179,153	0.6
Biogen, Inc.	3.15%	05/01/2050	270	207,291	0.7
Bristol-Myers Squibb Co.	2.55%	11/13/2050	135	101,047	0.3
Bristol-Myers Squibb Co.	3.25%	08/01/2042	115	99,386	0.3
Cigna Corp.	4.80%	08/15/2038	295	293,864	1.0
CVS Health Corp.	4.30%	03/25/2028	108	101,554	0.3
CVS Health Corp.	4.78%	03/25/2038	205	200,942	0.7
CVS Health Corp.	5.05%	03/25/2048	175	178,250	0.6
Danaher Corp.	2.60%	10/01/2050	120	90,206	0.3
Danaher Corp.	4.38%	09/15/2045	95	93,812	0.3
Fresenius SE & Co. KGaA, Series 10Y	2.88%	02/15/2029	EUR 155	180,200	0.6
GlaxoSmithKline Capital, Inc.	4.20%	03/18/2043	USD 50	49,567	0.2
Koninklijke Philips NV	5.00%	03/15/2042	235	251,417	0.8
Pfizer, Inc.	4.13%	12/15/2046	150	146,622	0.5
Pfizer, Inc.	4.20%	09/15/2048	90	89,032	0.3
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	0.75%	07/09/2027	EUR 100	102,046	0.3
Thermo Fisher Scientific, Inc.	4.10%	08/15/2047	USD 85	81,223	0.3
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	3.05%	01/15/2026	44	39,055	0.1
				<u>2,891,083</u>	<u>9.6</u>
ENERGIE					
Contemporary Ruiding Development Ltd.	2.63%	09/17/2030	200	161,496	0.5

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
DIENSTLEISTUNGEN					
Alibaba Group Holding Ltd.	2.70%	02/09/2041	USD 400	€ 304,976	1.0%
PayPal Holdings, Inc.	3.25%	06/01/2050	110	92,111	0.3
				<u>397,087</u>	<u>1.3</u>
TECHNOLOGIE					
Alphabet, Inc.	1.10%	08/15/2030	245	187,941	0.6
Analog Devices, Inc.	5.30%	12/15/2045	90	96,342	0.3
Broadcom, Inc.	3.50%	02/15/2041	123	97,750	0.3
Cisco Systems, Inc.	5.90%	02/15/2039	85	99,536	0.3
International Business Machines Corp.	4.25%	05/15/2049	150	143,165	0.5
Lam Research Corp.	2.88%	06/15/2050	125	98,520	0.3
NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA, Inc.	3.25%	05/11/2041	156	127,978	0.4
NXP BV/NXP Funding LLC/NXP USA, Inc.	4.30%	06/18/2029	365	339,966	1.2
Oracle Corp.	3.85%	04/01/2060	165	136,286	0.5
Oracle Corp.	4.00%	11/15/2047	260	223,726	0.8
SK Hynix, Inc.	2.38%	01/19/2031	375	296,344	1.0
Skyworks Solutions, Inc.	1.80%	06/01/2026	83	68,648	0.2
				<u>1,916,202</u>	<u>6.4</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
MTR Corp. Ltd.	1.63%	08/19/2030	245	191,467	0.7
				<u>10,763,833</u>	<u>35.9</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series G	0.75%	06/04/2025	EUR 200	206,058	0.7
Banco de Credito del Peru	3.25%	09/30/2031	USD 117	94,506	0.3
Banco Santander SA	1.13%	06/23/2027	EUR 100	104,086	0.3
Banco Santander SA	2.75%	12/03/2030	USD 200	160,574	0.5
Bank Of America Corp.	0.58%	08/24/2028	EUR 150	150,597	0.5
Bank of America Corp.	2.69%	04/22/2032	USD 365	304,229	1.0
Bank of America Corp.	3.19%	07/23/2030	100	87,411	0.3
Bank of America Corp., Series X(a)	6.25%	09/05/2024	20	18,205	0.1
Bank of America Corp., Series Z(a)	6.50%	10/23/2024	155	144,545	0.5
Bank of Montreal	1.76%	03/10/2026	CAD 300	205,554	0.7
Banque Federative du Credit Mutuel SA	0.10%	10/08/2027	EUR 200	198,419	0.7
Barclays PLC	1.70%	11/03/2026	GBP 100	118,063	0.4
BNP Paribas SA(a)	6.75%	03/14/2022	USD 210	178,478	0.6
BPCE SA	4.63%	07/11/2024	200	181,002	0.6
BPCE SA	5.25%	04/16/2029	GBP 200	285,535	1.0
Caix bank SA	0.00%	12/03/2026	200	232,904	0.8
Canadian Imperial Bank of Commerce, Series DPNT	2.90%	09/14/2021	CAD 30	20,518	0.1
Citigroup, Inc.	0.78%	10/30/2024	USD 65	53,573	0.2
Citigroup, Inc.	4.41%	03/31/2031	220	207,867	0.7
Cooperatieve Rabobank UA(a)	4.38%	06/29/2027	EUR 200	219,944	0.7
Cooperatieve Rabobank UA	5.25%	09/14/2027	GBP 160	223,667	0.7
Credit Agricole SA	0.13%	12/09/2027	EUR 200	195,454	0.6
Credit Agricole SA	2.00%	03/25/2029	100	107,028	0.4
Credit Agricole SA(a)	4.00%	12/23/2027	200	217,031	0.7
DNB Bank ASA(a)	6.50%	03/26/2022	USD 200	170,471	0.6
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	4.41%	04/23/2039	150	145,756	0.5
ING Groep NV	0.25%	02/01/2030	EUR 100	96,603	0.3
ING Groep NV	1.40%	07/01/2026	USD 225	185,782	0.6
ING Groep NV(a)	6.50%	04/16/2025	400	364,496	1.2
KBC Group NV	0.38%	06/16/2027	EUR 400	402,771	1.3
Lloyds Banking Group PLC	4.65%	03/24/2026	USD 200	185,787	0.6
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	0.85%	07/19/2029	EUR 200	205,130	0.7
Morgan Stanley	0.41%	10/29/2027	305	304,828	1.0
Morgan Stanley, Series G	4.35%	09/08/2026	USD 195	182,134	0.6
Natwest Group PLC	0.78%	02/26/2030	EUR 210	208,753	0.7
Natwest Group PLC	2.36%	05/22/2024	USD 200	169,326	0.6
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	200	179,029	0.6
Standard Chartered PLC	1.21%	03/23/2025	355	293,830	1.0
				<u>7,009,944</u>	<u>23.4</u>
VERSICHERUNGEN					
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.75%	08/15/2050	200	184,994	0.6
Assicurazioni Generali SpA	2.12%	10/01/2030	EUR 200	208,588	0.7
Assicurazioni Generali SpA	2.43%	07/14/2031	100	106,218	0.4
CNP Assurances	2.00%	07/27/2050	300	309,920	1.0
Zurich Finance Ireland Designated Activity Co.	3.00%	04/19/2051	USD 380	305,422	1.0
				<u>1,115,142</u>	<u>3.7</u>
REITS					
Alexandria Real Estate Equities, Inc.	2.00%	05/18/2032	160	125,247	0.4
American Tower Corp.	2.95%	01/15/2051	133	99,524	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
American Tower Corp.....	3.70%	10/15/2049	USD 22	€ 18,683	0.1%
American Tower Corp.....	3.80%	08/15/2029	190	171,702	0.6
Digital Dutch Finco BV.....	1.00%	01/15/2032	EUR 100	97,784	0.3
Digital Euro Finco LLC.....	2.50%	01/16/2026	275	302,012	1.0
Digital Intrepid Holding BV.....	0.63%	07/15/2031	136	129,425	0.4
Healthpeak Properties, Inc.....	3.50%	07/15/2029	USD 195	175,093	0.6
Office Properties Income Trust.....	2.65%	06/15/2026	365	301,556	1.0
Omega Healthcare Investors, Inc.....	3.38%	02/01/2031	185	153,940	0.5
Prologis LP.....	3.00%	04/15/2050	65	52,028	0.2
Ventas Realty LP.....	4.40%	01/15/2029	185	172,513	0.6
Vornado Realty LP.....	2.15%	06/01/2026	365	302,387	1.0
Welltower, Inc.....	4.95%	09/01/2048	220	219,763	0.7
				<u>2,321,657</u>	<u>7.7</u>
				<u>10,446,743</u>	<u>34.8</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Brookfield Renewable Partners ULC.....	4.25%	01/15/2029	CAD 270	208,436	0.7
Commonwealth Edison Co.....	3.00%	03/01/2050	USD 50	40,421	0.1
Consolidated Edison Co. of New York, Inc., Series 20A.....	3.35%	04/01/2030	432	385,791	1.3
Consortio Transmuntaro SA.....	4.70%	04/16/2034	200	179,179	0.6
EDP Finance BV.....	1.71%	01/24/2028	245	196,633	0.7
Enel Finance International NV.....	1.13%	10/17/2034	EUR 100	103,970	0.3
Enel Finance International NV.....	2.65%	09/10/2024	USD 205	176,877	0.6
Engie SA(a).....	1.50%	05/30/2028	EUR 200	198,714	0.7
Engie SA(a).....	3.25%	11/28/2024	100	108,094	0.4
Exelon Generation Co. LLC.....	6.25%	10/01/2039	USD 60	58,762	0.2
Florida Power & Light Co.....	4.13%	02/01/2042	90	87,790	0.3
National Grid PLC.....	0.16%	01/20/2028	EUR 310	303,928	1.0
Niagara Mohawk Power Corp.....	1.96%	06/27/2030	USD 220	176,221	0.6
Orsted AS(a).....	2.50%	02/18/3021	GBP 127	146,588	0.5
Public Service Electric and Gas Co.....	3.80%	01/01/2043	USD 35	32,172	0.1
Scottish Hydro Electric Transmission PLC.....	2.25%	09/27/2035	GBP 200	235,189	0.8
TenneT Holding BV(a).....	2.37%	07/22/2025	EUR 102	105,294	0.3
				<u>2,744,059</u>	<u>9.2</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
American Water Capital Corp.....	3.25%	06/01/2051	USD 185	152,581	0.5
American Water Capital Corp.....	3.45%	05/01/2050	11	9,358	0.0
American Water Capital Corp.....	4.30%	12/01/2042	100	97,253	0.3
Anglian Water Services Financing PLC.....	1.63%	08/10/2025	GBP 160	192,673	0.7
Sewern Trent Utilities Finance PLC.....	2.00%	06/02/2040	100	112,842	0.4
United Utilities Water Finance PLC.....	0.88%	10/28/2029	200	221,420	0.7
United Utilities Water Finance PLC.....	1.88%	06/03/2042	110	122,467	0.4
				<u>908,594</u>	<u>3.0</u>
				<u>3,652,653</u>	<u>12.2</u>
				<u>24,863,229</u>	<u>82.9</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC.....	2.00%	09/01/2028	EUR 310	309,095	1.0
Clean Harbors, Inc.....	4.88%	07/15/2027	USD 56	48,267	0.2
GFL Environmental, Inc.....	4.25%	06/01/2025	80	67,979	0.2
GFL Environmental, Inc.....	5.13%	12/15/2026	73	62,910	0.2
				<u>488,251</u>	<u>1.6</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Telefonica Europe BV(a).....	2.38%	02/12/2029	EUR 100	96,499	0.3
Telefonica Europe BV(a).....	2.50%	02/05/2027	100	100,988	0.4
				<u>197,487</u>	<u>0.7</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Dana, Inc.....	4.25%	09/01/2030	USD 89	75,352	0.3
ZF Finance GmbH.....	2.00%	05/06/2027	EUR 100	100,204	0.3
				<u>175,556</u>	<u>0.6</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Astrazeneca Finance LLC.....	2.25%	05/28/2031	USD 98	80,428	0.3
Catalent Pharma Solutions, Inc.....	2.38%	03/01/2028	EUR 100	99,889	0.3
DaVita, Inc.....	4.63%	06/01/2030	USD 145	121,424	0.4
Emergent BioSolutions, Inc.....	3.88%	08/15/2028	160	128,834	0.4
US Acute Care Solutions LLC.....	6.38%	03/01/2026	55	46,677	0.2
				<u>477,252</u>	<u>1.6</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
ENERGIE						
	Renewable Energy Group, Inc.	5.88%	06/01/2028	USD 48	€ 40,949	0.1%
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
	Rexel SA	2.13%	06/15/2028	EUR 206	209,359	0.7
DIENSTLEISTUNGEN						
	Square, Inc.	3.50%	06/01/2031	USD 365	299,402	1.0
	Techem Verwaltungsgesellschaft 675 mbH	2.00%	07/15/2025	EUR 100	98,780	0.3
					398,182	1.3
					1,987,036	6.6
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
	IndusInd Bank Ltd./Gift City	3.88%	04/15/2022	USD 210	173,156	0.6
	Itau Unibanco Holding SA/Cayman Island	3.88%	04/15/2031	400	324,999	1.1
					498,155	1.7
SONSTIGE FINANZWERTE						
	India Green Power Holdings	4.00%	02/22/2027	375	305,555	1.0
					803,710	2.7
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
	HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	200	174,238	0.6
	Klabin Austria GmbH	3.20%	01/12/2031	200	158,247	0.5
					332,485	1.1
ENERGIE						
	Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	200	176,309	0.6
DIENSTLEISTUNGEN						
	MercadoLibre, Inc.	3.13%	01/14/2031	330	262,537	0.8
					771,331	2.5
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
	Clean Renewable Power Mauritius Pte Ltd.	4.25%	03/25/2027	400	330,436	1.1
					1,905,477	6.3
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN						
CHILE						
	Chile Government International Bond.	2.55%	01/27/2032	355	293,080	1.0
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN						
VEREINIGTE STAATEN						
	Metropolitan Transportation Authority Series 2020C			115,000	120,073	0.4
					29,168,895	97.2
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT						
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
	Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	110	92,939	0.3
Gesamtanlagen						
	(Kosten €29,825,513)				€ 29,261,834	97.5%
Termineinlagen						
	Barclays, London(b)	0.01 %	—		137,919	0.5
	Sumitomo, Tokyo(b)	(0.78)%	—		420,081	1.4
	Sumitomo, Tokyo(b)	0.01 %	—		24,339	0.1
	Termineinlagen insgesamt				582,339	2.0
	Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				154,261	0.5
	Nettovermögen				€ 29,998,434	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Canadian 10 Yr Bond Futures	09/21/2021	2	€ 195,254	€ 195,838	€ 584
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	3	542,823	543,034	211
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	09/30/2021	14	1,419,486	1,421,888	2,402
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	09/21/2021	2	304,722	303,825	(897)

Bezeichnung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Short					
Euro-Bund Futures	06/08/2021	7	€ 1,197,420	€ 1,189,580	€ 7,840
Euro-schatz Future	06/08/2021	3	336,255	336,135	120
Long Gilt Futures	09/28/2021	1	147,891	148,089	(198)
U.S. 10 Yr Ultra Bond Futures	09/21/2021	12	1,423,183	1,426,412	(3,229)
U.S. Long Bond (CBT) Futures	09/21/2021	5	643,758	641,810	1,948
					€ 8,781
				Wertsteigerung	€ 13,105
				Wertminderung	€ (4,324)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	USD	5,703	EUR	4,709	06/30/2021	€ 34,799
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	2,860	EUR	2,434	06/14/2021	88,889
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	179	GBP	155	06/17/2021	927
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD	660	EUR	437	07/16/2021	(10,740)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	4,703	EUR	3,840	07/16/2021	(13,735)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	459	EUR	374	08/03/2021	(1,455)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	92	EUR	76	08/03/2021	95
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	5,807	EUR	4,757	08/16/2021	1,679
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	9,041	AUD	14,245	06/30/2021	(39,462)
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	27	GBP	23	06/30/2021	140
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR	434	USD	530	06/30/2021	915
Citibank, NA	USD	4,703	EUR	3,838	08/03/2021	(13,652)
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	5,696	EUR	4,755	06/01/2021	84,081
Societe Generale	GBP	1,623	EUR	1,877	06/17/2021	(11,204)
						€ 121,277
					Wertsteigerung	€ 211,525
					Wertminderung	€ (90,248)

+ 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:

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

Glossar:

CBT – Chicago Board of Trade
REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Grubhub, Inc.	88,540	\$ 5,322,139	3.2%
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
GrandVision NV	134,523	4,478,403	2.7
Sportsman's Warehouse Holdings, Inc.	207,391	3,691,560	2.3
		<u>8,169,963</u>	<u>5.0</u>
		<u>13,492,102</u>	<u>8.2</u>
DIVERSIFIZIERT			
ERWERBSGESELLSCHAFT FÜR BESONDERE ZWECKE			
Austerlitz Acquisition Corp. I	38,242	377,831	0.2
CC Neuberger Principal Holdings III	41,262	412,620	0.3
Churchill Capital Corp. VII	9,338	91,326	0.1
Constellation Acquisition Corp. I	17,976	175,805	0.1
Crucible Acquisition Corp.	31,736	308,474	0.2
DiamondHead Holdings Corp.	20,495	198,392	0.1
Fortress Capital Acquisition Corp.	36,275	353,681	0.2
Global Partner Acquisition Corp. II	36,275	355,132	0.2
Global Synergy Acquisition Corp.	40,030	388,691	0.3
Gores Metropolis II, Inc.	14,510	143,069	0.1
Group Nine Acquisition Corp.	18,138	176,845	0.1
Hudson Executive Investment Corp. II	38,285	376,724	0.2
New Vista Acquisition Corp.	37,084	358,602	0.2
North Atlantic Acquisition Cor	38,287	371,001	0.2
Northern Genesis Acquisition Corp. II	36,275	355,495	0.2
Pioneer Merger Corp.	36,275	358,397	0.2
Pontem Corp.	36,275	351,505	0.2
Powered Brands	39,235	385,288	0.2
RMG Acquisition Corp. III	5,984	58,524	0.1
Rotor Acquisition Corp.	36,275	359,122	0.2
Seven Oaks Acquisition Corp.	36,275	354,407	0.2
Star Peak Corp. II	30,829	304,282	0.2
Thunder Bridge Capital Partners III, Inc.	9,974	96,848	0.1
TLG Acquisition One Corp.	38,336	370,709	0.2
VectoIQ Acquisition Corp. II	18,138	176,755	0.1
		<u>7,259,525</u>	<u>4.4</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
CIT Group, Inc.	113,936	6,036,329	3.6
Compute Health Acquisition Corp.	36,080	351,780	0.2
TCF Financial Corp.	102,880	4,886,800	3.0
		<u>11,274,909</u>	<u>6.8</u>
GESUNDHEITSWESSEN			
GESUNDHEITSWESSEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Cantel Medical Corp.	30,060	2,444,780	1.5
GESUNDHEITSWESSEN – TECHNOLOGIE			
Change Healthcare, Inc.	253,976	5,953,197	3.6
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Luminex Corp.	104,872	3,868,728	2.3
PPD, Inc.	108,946	5,024,590	3.1
		<u>8,893,318</u>	<u>5.4</u>
		<u>17,291,295</u>	<u>10.5</u>
INDUSTRIEGÜTER			
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Seaport Global Acqui-class A	3,753	37,305	0.0
MASCHINEN			
Navistar International Corp.	18,757	829,622	0.5
		<u>866,927</u>	<u>0.5</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Coherent, Inc.	22,825	5,994,073	3.6
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Cardtronics PLC - Class A	55,154	2,147,145	1.3
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Maxim Integrated Products, Inc.	63,964	6,524,968	4.0

		Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SOFTWARE						
	Nuance Communications, Inc.			105,525	\$ 5,582,273	3.4%
	Slack Technologies, Inc. - Class A			121,371	5,345,179	3.2
					10,927,452	6.6
					25,593,638	15.5
GRUNDSTOFFE						
BAUMATERIAL						
	Forterra, Inc.			146,569	3,426,783	2.1
IMMOBILIEN						
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)						
	VEREIT, Inc.			130,739	6,219,254	3.8
VERSORGUNG						
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE						
	PNM Resources, Inc.			14,239	699,420	0.4
					86,123,853	52.2
GELDMARKTINSTRUMENTE						
US-SCHATZWECHSEL						
	U.S. Treasury Bill	0.00%	06/08/2021	USD 2,909	2,909,197	1.8
	U.S. Treasury Bill(a)	0.00%	06/10/2021	2,924	2,923,697	1.8
	U.S. Treasury Bill	0.00%	07/01/2021	2,261	2,260,691	1.4
	U.S. Treasury Bill(a)	0.00%	07/15/2021	1,521	1,520,981	0.9
	U.S. Treasury Bill	0.00%	07/22/2021	7,659	7,659,291	4.6
	U.S. Treasury Bill(a)	0.00%	10/21/2021	12,616	12,615,405	7.6
					29,889,262	18.1
OPTIONSSCHEINE						
DIVERSIFIZIERT						
ERWERBSGESELLSCHAFT FÜR BESONDERE ZWECKE						
	Austerlitz Acquisition Corp. I, - Class A, expiring 02/19/2026.			9,560	14,436	0.0
	CC Neuberger Principal Holdings III, expiring 12/31/2027			8,252	9,242	0.0
	Churchill Capital Corp. VII, expiring 02/29/2028.			1,867	2,147	0.0
	Compute Health Acquisition Corp., - Class A, expiring 12/31/2027. .			9,020	10,734	0.0
	Constellation Acquisition Corp. I, expiring 12/31/2027			5,992	4,426	0.0
	Crucible Acquisition Corp., expiring 12/26/2025			10,578	10,684	0.0
	DiamondHead Holdings Corp., expiring 01/28/2028			5,123	5,635	0.0
	Fortress Capital Acquisition Corp., expiring 12/31/2027			7,255	7,110	0.0
	Global Partner Acquisition Corp. II, expiring 12/31/2027			6,045	5,428	0.0
	Global Synergy Acquisition Corp., - Class A, expiring 12/22/2025 ..			20,015	12,035	0.0
	Gores Metropoulos II, Inc., expiring 01/31/2028			2,902	3,366	0.0
	Group Nine Acquisition Corp., expiring 01/14/2026.			6,046	4,308	0.0
	New Vista Acquisition Corp., expiring 12/31/2027			9,571	8,518	0.0
	North Atlantic Acquisition Corp., expiring 10/20/2025.			12,361	10,260	0.0
	Northern Genesis Acquisition Corp. II, expiring 12/31/2027			12,762	11,186	0.0
	Northern Star Investment Corp. II, expiring 01/31/2028.			12,091	16,021	0.0
	Gores Metropoulos II, Inc., expiring 01/31/2028			5,105	9,341	0.0
	Pioneer Merger Corp., expiring 12/31/2027			12,091	18,136	0.1
	Pontem Corp., expiring 12/31/2027			12,091	9,672	0.0
	Powered Brands, expiring 12/31/2027.			13,078	9,285	0.0
	RMG Acquisition Corp. III, - Class A, expiring 12/31/2027.			1,196	1,041	0.0
	Rotor Acquisition Corp., expiring 06/15/2027			18,137	18,137	0.0
	Seven Oaks Acquisition Corp., - Class A, expiring 12/22/2025			18,137	14,802	0.0
	Star Peak Corp. II, expiring 12/24/2025			7,707	10,404	0.0
	Thunder Bridge Capital Partners III, Inc., - Class A, expiring 02/15/2028			1,994	1,854	0.0
	TLG Acquisition One Corp., expiring 12/31/2028			12,778	8,050	0.0
	VectoIQ Acquisition Corp. II, expiring 12/31/2027			3,627	3,772	0.0
					240,030	0.1
Gesamtanlagen						
	(Kosten \$111,889,522)				\$ 116,253,145	70.4%
Termineinlagen						
	BNP Paribas, Paris(b)	(0.29)%	—		750,810	0.5
	Credit Suisse AG, Zurich (b)	(1.44)%	—		8,187	0.0
	Nordea Bank Abp, Oslo(b)	(0.78)%	—		10,085	0.0
	Royal Bank of Canada, Toronto(b)	0.01 %	—		21,255	0.0
	SEB, Stockholm(b)	(0.28)%	—		4,835	0.0
	SEB, Stockholm(b)	0.01 %	—		6,076,047	3.7
	Sumitomo, Tokyo(b)	0.01 %	—		18,617	0.0
Termineinlagen insgesamt						
					6,889,836	4.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten						
					41,941,626	25.4
Nettovermögen						
					\$ 165,084,607	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 156,985	EUR 128,485	06/21/2021	\$ (246,634)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 3,622	USD 4,438	08/03/2021	15,756
				\$ (230,878)
			Wertsteigerung	\$ 15,756
			Wertminderung	\$ (246,634)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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					
Credit Suisse International					
TPXDDVD	336,662	LIBOR Minus 0.45%	JPY 997,503	02/15/2022	\$ (331,957)
TPXDDVD	490,054	LIBOR Minus 0.45%	1,451,991	02/15/2022	(483,205)
Goldman Sachs International					
Aggreko PLC	491,576	LIBOR Plus 0.35%	GBP 4,273	01/05/2023	(66,309)
Arrow Global Group PLC	424,187	LIBOR Plus 0.35%	1,288	01/05/2023	2,210
Cooper Tire & Rubber Co.	7,601	LIBOR Plus 0.35%	USD 451	07/15/2025	18,342
Cooper Tire & Rubber Co.	87,232	LIBOR Plus 0.35%	4,952	01/05/2023	210,496
Enable Midstream Partners LP	2,337	LIBOR Plus 0.35%	20	07/15/2025	(391)
Enable Midstream Partners LP	172,490	LIBOR Plus 0.35%	1,488	01/05/2023	(28,829)
Flagstar Bancorp, Inc.	9,441	LIBOR Plus 0.35%	440	07/15/2025	(11,166)
Flagstar Bancorp, Inc.	117,499	LIBOR Plus 0.35%	5,524	01/05/2023	(138,970)
Kansas City Southern	17,288	LIBOR Plus 0.35%	4,437	01/05/2023	709,321
Knoll, Inc.	81,169	LIBOR Plus 0.35%	1,890	01/05/2023	220,478
MagnaChip Semiconductor Corp.	73,756	LIBOR Plus 0.35%	1,773	01/05/2023	(25,360)
Meridian Bancorp, Inc.	39,959	LIBOR Plus 0.35%	877	01/05/2023	4,371
ORBCOMM, Inc.	65,718	LIBOR Plus 0.35%	739	01/05/2023	(3,266)
Peoples United Financial, Inc.	246,529	LIBOR Plus 0.35%	4,479	01/05/2023	183,289
PRA Health Sciences, Inc.	35,460	LIBOR Plus 0.35%	5,354	01/05/2023	707,026
Proofpoint, Inc.	17,178	LIBOR Plus 0.35%	2,953	01/05/2023	15,549
RSA Insurance Group PLC	602,631	LIBOR Plus 0.35%	GBP 4,076	01/05/2023	65,553
Shaw Communications, Inc.	196,086	CDOR Plus 0.35%	CAD 6,583	01/05/2023	413,191
Signature Aviation PLC	869	LIBOR Plus 0.35%	USD 5	07/15/2025	43
Signature Aviation PLC	758,853	LIBOR Plus 0.35%	4,227	01/05/2023	37,867
Siltronic AG	34,973	EURIBOR Plus 0.35%	EUR 4,874	01/05/2023	9,510
Slack Technologies, Inc.	4,812	LIBOR Plus 0.35%	USD 207	01/05/2023	5,149
Talend SA	37,951	LIBOR Plus 0.35%	2,447	01/05/2023	18,497
Weingarten Realty Investors	4,688	LIBOR Plus 0.35%	143	01/05/2023	10,478
Welbilt, Inc.	83,948	LIBOR Plus 0.35%	1,825	01/05/2023	346,383
Welbilt, Inc.	141,431	LIBOR Plus 0.35%	2,814	07/15/2025	583,567
WR Grace & Co.	21,569	LIBOR Plus 0.35%	1,474	01/05/2023	3,460
JPMorgan Chase Bank, NA					
Cantel Medical Corp.	37,208	LIBOR Plus 0.40%	2,919	08/12/2022	107,234
Dialog Semiconductor PLC	70,615	EURIBOR Plus 0.40%	EUR 4,569	08/12/2022	26,455
Domtar Corp.	82,058	EURIBOR Plus 0.40%	USD 4,462	08/12/2022	(12,436)
Ferro Corp.	35,082	LIBOR Plus 0.40%	754	08/12/2022	3,684
IHS Markit Ltd.	54,934	LIBOR Plus 0.40%	5,583	08/12/2022	202,269
PNM Resources, Inc.	105,730	LIBOR Plus 0.40%	5,186	08/12/2022	7,045
TCF Financial Corp.	25,856	LIBOR Plus 0.40%	1,136	08/12/2022	91,988
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Alexion Pharmaceuticals, Inc.	34,993	LIBOR Plus 0.30%	5,434	12/13/2021	743,951
Athene Holding, Ltd.	74,437	LIBOR Plus 0.30%	4,349	12/13/2021	313,079
Cinemark Holdings, Inc.	2,818	LIBOR Plus 0.30%	124	12/13/2021	5,507
CoreLogic, Inc.	23,177	LIBOR Plus 0.30%	1,842	12/13/2021	601
Deutsche Wohnen SE	30,879	EURIBOR Plus 0.50%	EUR 1,611	12/13/2021	1,159
Magellan Health, Inc.	49,175	LIBOR Plus 0.30%	USD 4,624	12/13/2021	7,576
Progenics Pharmaceuticals, Inc.	183,293	LIBOR	0**	12/13/2021	0
Tikkurila Oyj	118,007	EURIBOR Plus 0.50%	EUR 3,629	12/13/2021	452,470
Towers Watson & Co.	23,155	LIBOR Plus 0.30%	USD 5,432	12/13/2021	619,627
Xilinx, Inc.	37,824	LIBOR Plus 0.30%	4,675	12/13/2021	128,962
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Bank of America, NA					
MLABJPBB	7,681,195	0.20%	JPY 717,961	02/15/2022	(62,941)
Credit Suisse International					
CSABJPSS	2,251,375	0.00%	2,456,565	02/15/2022	465,095
Goldman Sachs International					
Analog Devices, Inc.	13,652	LIBOR Plus 0.35%	USD 1,644	01/05/2023	(576,880)
Analog Devices, Inc.	17,506	LIBOR Minus 0.29%	2,003	01/05/2023	(739,735)

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Analog Devices, Inc.	2,856	LIBOR Minus 0.28%	USD 336	01/05/2023	\$ (120,683)
Analog Devices, Inc.	6,283	LIBOR Minus 0.27%	947	01/05/2023	(265,495)
Canadian National Railway Co.	19,518	LIBOR Minus 0.24%	2,064	07/15/2025	(133,178)
Energy Transfer LP	148,255	LIBOR Minus 0.30%	1,514	01/05/2023	46,501
Energy Transfer LP	2,009	LIBOR Minus 0.30%	21	07/15/2025	630
Goodyear Tire & Rubber Co.	1,592	LIBOR Minus 0.06%	31	01/05/2023	(3,199)
Goodyear Tire & Rubber Co.	923	LIBOR Minus 0.06%	17	07/15/2025	(1,855)
Goodyear Tire & Rubber Co.	89	LIBOR Minus 0.05%	2	01/05/2023	(179)
Goodyear Tire & Rubber Co.	33,398	LIBOR Minus 0.31%	548	01/05/2023	(67,114)
Goodyear Tire & Rubber Co.	40,371	LIBOR Minus 0.30%	747	01/05/2023	(81,126)
Goodyear Tire & Rubber Co.	6,011	LIBOR Minus 0.30%	118	07/15/2025	(12,079)
Goodyear Tire & Rubber Co.	806	LIBOR Minus 0.29%	15	01/05/2023	(1,620)
Goodyear Tire & Rubber Co.	2,863	LIBOR Minus 0.27%	55	01/05/2023	(5,753)
GSABFUS1	776,663	0.00%	77,775	10/15/2025	(7,767)
Herman Miller, Inc.	3,810	LIBOR Minus 0.07%	152	01/05/2023	(29,280)
Herman Miller, Inc.	22,134	LIBOR Minus 0.30%	889	01/05/2023	(170,101)
ICON PLC	989	LIBOR Minus 0.24%	215	01/05/2023	(34,510)
ICON PLC	12,151	LIBOR Minus 0.23%	2,288	01/05/2023	(423,997)
ICON PLC	1,487	LIBOR Plus 0.00%	260	01/05/2023	(51,887)
II-VI, Inc.	12,878	LIBOR Minus 0.31%	866	01/05/2023	(2,076)
II-VI, Inc.	6,444	LIBOR Minus 0.30%	436	01/05/2023	(1,039)
II-VI, Inc.	1,448	LIBOR Minus 0.27%	93	01/05/2023	(233)
Independent Bank Corp.	509	LIBOR Minus 0.07%	42	01/05/2023	36
Independent Bank Corp.	105	LIBOR Minus 0.06%	9	01/05/2023	7
Independent Bank Corp.	601	LIBOR Minus 0.30%	49	01/05/2023	42
Independent Bank Corp.	1,481	LIBOR Minus 0.29%	115	01/05/2023	103
Independent Bank Corp.	8,319	LIBOR Minus 0.27%	685	01/05/2023	581
Kimco Realty Corp.	6,593	LIBOR Minus 0.30%	131	01/05/2023	(9,485)
M&T Bank Corp.	3,195	LIBOR Minus 0.07%	502	01/05/2023	(13,351)
M&T Bank Corp.	127	LIBOR Minus 0.05%	20	01/05/2023	(531)
M&T Bank Corp.	17,755	LIBOR Minus 0.30%	2,744	01/05/2023	(74,192)
M&T Bank Corp.	3,761	LIBOR Minus 0.29%	615	01/05/2023	(15,716)
M&T Bank Corp.	2,829	LIBOR Minus 0.28%	445	01/05/2023	(11,821)
M&T Bank Corp.	1,423	LIBOR Minus 0.27%	226	01/05/2023	(5,946)
Middleby Corp.	16	LIBOR Minus 0.27%	3	01/05/2023	112
Middleby Corp.	82	LIBOR Minus 0.06%	15	01/05/2023	575
Middleby Corp.	21	LIBOR Minus 0.05%	4	01/05/2023	147
Middleby Corp.	17,522	LIBOR Minus 0.30%	2,915	07/15/2025	122,912
Middleby Corp.	10,305	LIBOR Minus 0.29%	1,850	01/05/2023	72,287
New York Community Bancorp, Inc.	22,092	LIBOR Minus 0.07%	273	01/05/2023	4,997
New York Community Bancorp, Inc.	37,906	LIBOR Minus 0.30%	456	07/15/2025	8,575
New York Community Bancorp, Inc.	321,061	LIBOR Minus 0.30%	4,014	01/05/2023	72,626
New York Community Bancorp, Inc.	128,617	LIBOR Minus 0.29%	1,474	01/05/2023	29,094
salesforce.com, Inc.	485	LIBOR Minus 0.08%	115	01/05/2023	(6,391)
salesforce.com, Inc.	792	LIBOR Minus 0.30%	188	01/05/2023	(10,437)
salesforce.com, Inc.	7,252	LIBOR Minus 0.29%	1,622	01/05/2023	(95,563)
salesforce.com, Inc.	475	LIBOR Minus 0.29%	107	01/27/2022	(6,259)
salesforce.com, Inc.	787	LIBOR Minus 0.27%	170	01/05/2023	(10,371)
JPMorgan Chase Bank, NA					
First Citizens Bancshares	5,997	LIBOR Minus 0.31%	4,958	08/12/2022	(190,321)
First Citizens Bancshares	1,068	LIBOR Minus 0.30%	898	08/12/2022	(33,894)
Huntington Bancshares, Inc.	33,450	LIBOR Minus 0.31%	503	08/12/2022	(98,926)
Huntington Bancshares, Inc.	346,337	LIBOR Minus 0.30%	4,397	08/12/2022	(1,024,268)
Realty Income Corp.	6,911	LIBOR Minus 0.32%	473	08/12/2022	1,925
Realty Income Corp.	52,963	LIBOR Minus 0.31%	3,673	08/12/2022	14,756
Realty Income Corp.	12,156	LIBOR Minus 0.30%	824	08/12/2022	3,387
Realty Income Corp.	20,140	LIBOR Minus 0.28%	1,360	08/12/2022	5,611
S&P Global, Inc.	843	LIBOR Minus 0.31%	278	08/12/2022	(43,143)
S&P Global, Inc.	14,747	LIBOR Minus 0.30%	4,840	08/12/2022	(754,725)
STERIS PLC	89	LIBOR Minus 0.32%	18	08/12/2022	(288)
STERIS PLC	13,164	LIBOR Minus 0.31%	2,412	08/12/2022	(42,529)
STERIS PLC	9,473	LIBOR Minus 0.30%	1,834	08/12/2022	(30,604)
STERIS PLC	10	LIBOR Minus 0.28%	2	08/12/2022	(32)
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Advanced Micro Devices	29,602	LIBOR Minus 0.08%	2,409	12/13/2021	(32,117)
Advanced Micro Devices	13,692	LIBOR Minus 0.31%	1,083	12/13/2021	(14,855)
Advanced Micro Devices	21,891	LIBOR Minus 0.29%	1,658	12/13/2021	(23,751)
Aon PLC	4,721	LIBOR Minus 0.40%	773	12/13/2021	(362,205)
Aon PLC	9,551	LIBOR Minus 0.30%	1,836	12/13/2021	(732,772)
Aon PLC	3,219	LIBOR Minus 0.28%	532	12/13/2021	(246,968)
Aon PLC	4,550	LIBOR Minus 0.25%	811	12/13/2021	(349,085)
Aon PLC	2,966	LIBOR Minus 1.10%	465	12/13/2021	(227,558)
Apollo Global Management, Inc.	49	LIBOR Minus 0.56%	3	12/13/2021	(156)
Apollo Global Management, Inc.	436	LIBOR Minus 0.31%	21	12/13/2021	(1,385)

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahlter/Erhaltener Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Apollo Global Management, Inc.	67,750	LIBOR Minus 0.30%	USD 3,642	12/13/2021	\$ (215,263)
Apollo Global Management, Inc.	2,322	LIBOR Minus 0.28%	127	12/13/2021	(7,378)
Apollo Global Management, Inc.	14,971	LIBOR Minus 0.27%	839	12/13/2021	(47,568)
AstraZeneca PLC	15,463	LIBOR Minus 0.23%	763	12/13/2021	(98,347)
AstraZeneca PLC	58,872	LIBOR Minus 0.21%	2,984	12/13/2021	(374,433)
Huntington Bancshares, Inc.	6,772	LIBOR Minus 0.29%	84	12/13/2021	(23,014)
Just Eat Takeaway	59,411	EURIBOR Minus 0.35%	EUR 5,493	12/13/2021	1,329,496
MSABETFR	513,157	0.135%	USD 54,944	08/16/2021	(52,034)
MSABGSPO	405,403	0.20%	39,784	08/16/2021	(679,091)
Performance Food Group Co.	1,240	LIBOR Minus 0.30%	60	12/13/2021	(2,189)
Insgesamt					\$ (1,407,696)
				Wertsteigerung	\$ 8,455,882
				Wertminderung	\$ (9,863,578)

** Nomineller Betrag geringer als \$500.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

CDOR – Canadian Dealer Offered Rate
 EURIBOR – Euro Interbank Offered Rate
 LIBOR – London Interbank Offered Rate
 REIT – Real Estate Investment Trust

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Zinssatz	Datum	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Termineinlagen				
BNP Paribas, Paris(a)	(0.78)%	—	€ 24,051,067	14.2%
BNP Paribas, Paris(a)	(0.53)%	—	540,138	0.3
Citibank, London(a)	(0.78)%	—	15,042,332	8.9
Credit Suisse AG, Zurich(a)	(1.44)%	—	679,295	0.4
DBS Bank Ltd, Singapore(a)	0.01 %	—	4,579,720	2.7
Deutsche Bank, Frankfurt(a)	(0.78)%	—	24,591,172	14.5
HSBC Bank PLC, Paris(a)	(0.78)%	—	24,591,172	14.5
Nordea Bank Abp, Oslo(a)	(0.13)%	—	697,636	0.4
SEB, Stockholm(a)	(0.78)%	—	24,047,334	14.1
SEB, Stockholm(a)	(0.28)%	—	541,827	0.3
Sumitomo, London(a)	(0.78)%	—	24,591,172	14.5
Sumitomo, Tokyo(a)	(0.78)%	—	20,115,249	11.8
Sumitomo, Tokyo(a)	0.01 %	—	4,471,613	2.6
Termineinlagen insgesamt			168,539,727	99.2
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			1,443,621	0.8
Nettovermögen			€ 169,983,348	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Kontrahent	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 4,975	CHF 5,450	06/17/2021	€ (6,378)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 3,025	DKK 22,500	06/17/2021	(52)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 1,027	SEK 10,400	06/17/2021	(394)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 4,620	EUR 5,368	06/17/2021	(7,057)
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK 10,300	EUR 1,028	06/17/2021	18,215
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 582	CHF 641	06/21/2021	2,793
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 597	GBP 515	06/21/2021	2,363
				€ 9,490
			Wertsteigerung	€ 23,371
			Wertminderung	€ (13,881)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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					
Goldman Sachs International					
Alfa Laval AB	2,119	STIBOR Plus 0.35%	SEK 639	07/15/2021	€ 1,695
Anglo American Capital PLC	941	LIBOR Plus 0.35%	GBP 29	07/15/2021	635
Deutsche Post AG	1,395	LIBOR Plus 0.35%	EUR 76	07/15/2021	2,107
Equinor ASA	12,764	LIBOR Plus 0.35%	NOK 2,273	07/15/2021	4,880
Henkel AG & Co. KGaA	628	LIBOR Plus 0.35%	EUR 60	07/15/2021	(855)
HSBC Holdings PLC	28,126	LIBOR Plus 0.35%	GBP 125	07/15/2021	3,256
Jeronimo Martins	5,893	LIBOR Plus 0.35%	EUR 94	07/15/2021	(243)
Next PLC	101,379	LIBOR Plus 0.35%	GBP 8,166	07/15/2021	96,849
Pandora A/S	2,245	CIBOR	DKK 1,831	07/15/2021	2,409
Siemens AG	60,128	LIBOR Plus 0.35%	EUR 8,305	07/15/2021	(211,669)
Siemens Healthineers AG	5,717	LIBOR Plus 0.35%	266	07/15/2021	(1,936)
Stellantis NV	2,131	LIBOR Plus 0.35%	33	07/15/2021	1,336
Straumann Holding AG	123	LIBOR Plus 0.35%	CHF 172	07/15/2021	800
Temenos AG	46,387	LIBOR Plus 0.35%	6,189	07/15/2021	232,963
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Alfa Laval AB	162,815	STIBOR Minus 0.45%	SEK 48,307	10/18/2023	208,766
Anglo American PLC	74,113	LIBOR Plus 0.50%	GBP 2,405	10/18/2023	(100,992)
AstraZeneca PLC	84,556	LIBOR Plus 0.50%	6,685	10/18/2023	122,720
BNP Paribas SA	113,676	EURIBOR Plus 0.50%	EUR 6,134	10/18/2023	283,490
Compagnie de Saint-Gobain SA	138,781	EURIBOR Plus 0.50%	7,150	10/18/2023	489,054
Deutsche Post AG	60,544	EURIBOR Plus 0.50%	2,968	10/18/2023	404,233
Equinor ASA	565,895	NIBOR Plus 0.50%	NOK 96,211	10/18/2023	661,803
Henkel AG & Co. KGaA	25,964	EURIBOR Plus 0.50%	EUR 2,505	10/18/2023	(52,914)
HSBC Holdings PLC	2,060,091	LIBOR Plus 0.50%	GBP 9,132	10/18/2023	295,156
Jeronimo Martins	257,257	EURIBOR Plus 0.50%	EUR 3,701	10/18/2023	381,453
Nestle SA	62,377	LIBOR	CHF 6,880	10/18/2023	45,478
Pandora A/S	100,845	CIBOR	DKK 69,840	10/18/2023	1,778,390
Siemens Healthineers AG	250,606	EURIBOR Plus 0.50%	EUR 11,831	10/18/2023	(255,909)
Stellantis NV	433,678	EURIBOR Plus 0.50%	6,690	10/18/2023	266,649
Straumann Holding AG	5,251	LIBOR	CHF 6,482	10/18/2023	831,435

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahler/Erhalterner Zinssatz	Nomineller Betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Goldman Sachs International					
Adecco Group AG	3,048	LIBOR Minus 0.40%	CHF 186	07/15/2021	€ (3,056)
Allianz SE	477	LIBOR Minus 0.40%	EUR 102	07/15/2021	(1,854)
Amadeus IT Group SA	1,447	LIBOR Minus 0.45%	89	07/15/2021	(997)
AP Moller-Maersk A/S	33	CIBOR Minus 0.45%	DKK 558	07/15/2021	352
ArcelorMittal	945	LIBOR Minus 0.45%	EUR 24	07/15/2021	(1,215)
Assa Abloy AB	54,314	STIBOR Plus 0.45%	SEK 12,804	07/15/2021	(106,780)
BASF SE	1,276	LIBOR Minus 0.40%	EUR 85	07/15/2021	(498)
Bayerische Motoren Werke AG	1,894	LIBOR Minus 0.40%	163	07/15/2021	(2,307)
Bunzl PLC	4,637	LIBOR Minus 0.40%	GBP 106	07/15/2021	19
Continental AG	553	LIBOR Minus 0.40%	EUR 66	07/15/2021	(1,435)
Covestro AG	1,090	LIBOR Minus 0.40%	61	07/15/2021	(1,785)
Credit Suisse Group AG	482,954	LIBOR Minus 0.40%	CHF 4,675	07/15/2021	(65,522)
Essity AB	120,167	STIBOR Minus 0.45%	SEK 33,474	07/15/2021	(105,133)
HomeServe PLC	353,490	LIBOR Minus 0.40%	GBP 3,828	07/15/2021	610,769
Kone Oyj	1,458	LIBOR Minus 0.45%	EUR 98	07/15/2021	864
Koninklijke Philips NV	1,667	LIBOR Minus 0.45%	78	07/15/2021	827
Neste Oil Oyj	2,183	LIBOR Minus 0.45%	115	07/15/2021	(2,747)
Orsted A/S	908	CIBOR Minus 0.45%	DKK 852	07/15/2021	646
Valeo SA	2,437	LIBOR Minus 0.40%	EUR 64	07/15/2021	(1,483)
Worldline SA	1,243	LIBOR Minus 0.40%	97	07/15/2021	(1,036)
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Adecco Group AG	141,521	LIBOR Minus 0.40%	CHF 8,427	10/18/2023	(351,246)
Adecco Group AG	1,067	LIBOR	62	10/18/2023	(2,648)
Allianz SE	23,798	EURIBOR Minus 0.40%	EUR 5,051	10/18/2023	(131,433)
Amadeus IT Group SA	75,159	EURIBOR Minus 0.50%	4,417	10/18/2023	(233,202)
AP Moller-Maersk A/S	1,298	CIBOR Minus 0.50%	DKK 19,680	10/18/2023	(289,315)
ArcelorMittal	83,653	EURIBOR Minus 0.40%	EUR 2,120	10/18/2023	(98,835)
Associated British Foods	102,020	LIBOR Minus 0.35%	GBP 2,384	10/18/2023	26,158
BASF SE	75,638	EURIBOR Minus 0.40%	EUR 5,153	10/18/2023	75,229
Bayerische Motoren Werke AG	79,776	EURIBOR Minus 0.40%	6,504	10/18/2023	(449,434)
Bayerische Motoren Werke AG	833	EURIBOR	59	10/18/2023	(4,693)
Bunzl PLC	200,492	LIBOR Minus 0.35%	GBP 4,715	10/18/2023	161,210
Bunzl PLC	1,960	LIBOR	46	10/18/2023	1,576
Continental AG	31,248	EURIBOR Minus 0.40%	EUR 3,592	10/18/2023	(207,378)
Covestro AG	46,839	EURIBOR Minus 0.40%	2,638	10/18/2023	(44,464)
HomeServe PLC	22,146	LIBOR Minus 0.35%	GBP 221	10/18/2023	16,921
Kone Oyj	71,120	EURIBOR Minus 0.50%	EUR 4,787	10/18/2023	42,366
Koninklijke Philips NV	71,440	EURIBOR Minus 0.40%	3,303	10/18/2023	(5,250)
Koninklijke Philips NV	1,220	EURIBOR	59	10/18/2023	(90)
Lanxess AG	34,568	EURIBOR Minus 0.40%	2,119	10/18/2023	502
MSABGBS	307,464	LIBOR Plus 0.50%	GBP 7,694	10/18/2023	(223,808)
MSABEUCB	77,946	EURIBOR Minus 0.50%	EUR 18,043	10/18/2023	(563,397)
Neste Oil Oyj	103,401	EURIBOR Minus 0.50%	5,373	10/18/2023	(219,932)
Orsted A/S	37,820	CIBOR Minus 0.50%	DKK 36,257	10/18/2023	133,898
Orsted A/S	98	CIBOR	103	10/18/2023	347
Schneider Electric SE	20,444	EURIBOR Minus 0.40%	EUR 2,641	10/18/2023	(27,416)
Valeo SA	106,229	EURIBOR Minus 0.40%	3,053	10/18/2023	190,277
Worldline SA	59,041	EURIBOR Minus 0.40%	4,428	10/18/2023	(221,465)
Worldline SA	607	EURIBOR	48	10/18/2023	(2,277)
Insgesamt					€ 3,380,869
				Wertsteigerung	€ 7,377,518
				Wertminderung	€ (3,996,649)

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

CHF – Swiss Franc
 DKK – Danish Krone
 EUR – Euro
 GBP – Great British Pound
 NOK – Norwegian Krone
 SEK – Swedish Krona

Glossar:

CIBOR	–	Copenhagen Interbank Offered Rate
EURIBOR	–	Euro Interbank Offered Rate
LIBOR	–	London Interbank Offered Rate
STIBOR	–	Stockholm Interbank Offered Rate

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS

31. Mai 2021

AB SICAV I

	International Health Care Portfolio (USD)	International Technology Portfolio (USD)	Global Real Estate Securities Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 1,763,525,014	\$ 1,455,295,783	\$ 46,674,021
Termineinlagen	92,632,773	29,661,421	691,015
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	-0-	26,957,169	559,871
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	17,907,820	11,658,729	406,773
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	-0-	-0-	-0-
Dividenden- und Zinsforderungen	3,155,726	560,463	92,880
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	-0-	59,923	47,347
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	1,441	3,318	19
Abgegrenzte Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	-0-	-0-
	<u>1,877,222,774</u>	<u>1,524,196,806</u>	<u>48,471,926</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	14,200,300	24,923,829	547,755
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	3,511,881	1,803,907	218,290
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	8,618,567	7,395,757	442,227
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	2,064	412	29,684
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Zu zahlende Dividenden	26,758	-0-	28,606
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	-0-
Verbindlichkeiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte	-0-	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps	-0-	-0-	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	2,517,038	2,159,945	204,647
	<u>28,876,608</u>	<u>36,283,850</u>	<u>1,471,209</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 1,848,346,166</u>	<u>\$ 1,487,912,956</u>	<u>\$ 47,000,717</u>

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)
\$2,964,687,677	\$ 160,663,286	€ 350,357,647	\$ 164,065,912	\$ 1,180,561,605	CNH 4,990,007,471	\$1,300,498,192	\$ 3,507,473,793
64,753,533	1,419,856	1,164,147	1,423,634	22,598,203	28,781,351	19,149,106	75,568,595
9,353,114	1,131,277	3,546,763	696,929	3,257,786	-0-	1,118,207	50,047,135
53,457,103	1,271,770	445,807	3,294,837	2,639,301	118,563,373	12,477,001	49,164,024
1,261,394	1,011,486	418,512	-0-	64,900,856	239,821,782	16,680,437	-0-
3,574,359	-0-	4,063,437	145,938	9,103,841	69,450,068	16,832,375	3,853,019
11,095,020	2,491	32,378	-0-	4,473,345	78,836,816	539,408	2,241,330
-0-	-0-	-0-	-0-	4,770,816	-0-	4,623,146	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	5,670,268	-0-	9,767,843	-0-
-0-	-0-	15,700	-0-	2,092,201	97,833	237,673	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	41,092	5,118	939,844	-0-
28,931	-0-	-0-	-0-	34	-0-	-0-	105
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	466,512	-0-	-0-	58	-0-	-0-	-0-
<u>3,108,211,131</u>	<u>165,966,678</u>	<u>360,044,391</u>	<u>169,627,250</u>	<u>1,300,109,406</u>	<u>5,525,563,812</u>	<u>1,382,863,232</u>	<u>3,688,348,001</u>
8,141,510	975,889	2,364,541	461,979	4,873,728	79,237,907	6,183,430	67,871,805
18,029,947	-0-	1,566,569	1,014,738	49,067,378	1,621,288	11,466,263	3,329,419
3,790,993	3,138,770	168,553	656,196	6,192,859	2,376,041	2,906,337	34,679,474
4,044,931	1,703	149,451	50,656	9,735,809	600,700	719,017	228,552
-0-	-0-	-0-	-0-	2,846,714	3,651,967	7,681,266	-0-
134,069	4,083	180,715	-0-	3,397,685	9,625,074	527,119	22,657
-0-	-0-	-0-	-0-	116,479	15,311,944	2,266,646	-0-
-0-	-0-	19,710	-0-	16,406	596,989	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	404,589	1,067,507	274,613	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	152,480	-0-	-0-	-0-
<u>6,700,670</u>	<u>4,845,944</u>	<u>364,339</u>	<u>303,248</u>	<u>4,210,975</u>	<u>6,986,046</u>	<u>1,721,032</u>	<u>9,091,217</u>
<u>40,842,120</u>	<u>8,966,389</u>	<u>4,813,878</u>	<u>2,486,817</u>	<u>81,015,102</u>	<u>121,075,463</u>	<u>33,745,723</u>	<u>115,223,124</u>
<u>\$3,067,369,011</u>	<u>\$ 157,000,289</u>	<u>€ 355,230,513</u>	<u>\$ 167,140,433</u>	<u>\$ 1,219,094,304</u>	<u>CNH 5,404,488,349</u>	<u>\$1,349,117,509</u>	<u>\$ 3,573,124,877</u>

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)**31. Mai 2021****AB SICAV I**

	Global Plus Fixed Income Portfolio (USD)	Select Absolute Alpha Portfolio (USD)	Emerging Market Local Currency Debt Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 1,022,169,875	\$ 850,631,994	\$ 231,730,065
Termineinlagen	19,451,554	79,288,151	14,171,241
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	22,546,808	8,959,340	392
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	7,229,072	18,787,214	4,057
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	9,015,321	5,640,899	10,041,271
Dividenden- und Zinsforderungen	6,446,147	677,491	5,280,713
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	4,184,279	31,847	5,020,508
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	2,059,412	30,113	167,981
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	52,157	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	102,359	-0-	1,195
Zinsforderungen aus Swaps	43,520	-0-	296,113
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0-	12,287	-0-
Abgegrenzte Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	110,343	64,731
	<u>1,093,300,504</u>	<u>964,169,679</u>	<u>266,778,267</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	62,210,973	27,809,426	37,561
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	2,173,996	-0-	780,732
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	972,456	752,740	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	10,836,759	1,664,507	3,957,529
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	4,106,570	507,348	1,439,210
Zu zahlende Dividenden	99,966	-0-	1,570,722
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	1,079,854	-0-	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	230,990	1,554,853	12,140
Verbindlichkeiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte	-0-	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps	49,419	12,547	372,661
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	-0-	31,728
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	1,149,248	28,108,161	232,023
	<u>82,910,231</u>	<u>60,409,582</u>	<u>8,434,306</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 1,010,390,273</u>	<u>\$ 903,760,097</u>	<u>\$ 258,343,961</u>

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)
\$ 53,315,154	\$ 132,422,064	\$ 151,178,646	\$ 3,388,580,769	\$ 926,313,239	£ 773,247,203	\$1,285,206,372	\$ 658,415,646
2,258,642	5,658,084	6,483,310	69,124,147	54,612,376	8,442,072	12,284,546	21,639,724
-0-	699,499	761,843	107,956,122	-0-	5,778,759	-0-	-0-
45,021	351,600	41,839	23,758,799	177,565	34,338	74,826,074	4,054,280
844,195	518,900	1,853,385	500,000	4,092,804	6,979,796	-0-	13,156
689,365	1,736,595	2,190,954	7,300,497	1,422,383	5,847,388	701,217	944,415
343,251	111,870	35,409	3,457,159	299	10,430,931	39,257	2,616,566
-0-	71,353	488,863	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	1,087,450	-0-	-0-	27,020	-0-	-0-
352	2,641	33,860	-0-	-0-	333,986	-0-	-0-
-0-	185	135,162	-0-	-0-	2,076	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	30,079	562	-0-	-0-	90
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
6,824	16,070	24,618	-0-	-0-	20,610	-0-	-0-
<u>57,502,804</u>	<u>141,588,861</u>	<u>164,315,339</u>	<u>3,600,707,572</u>	<u>986,619,228</u>	<u>811,144,179</u>	<u>1,373,057,466</u>	<u>687,683,877</u>
1,397,114	1,293,440	1,934,486	53,099,018	918,658	3,179,339	54,652,377	-0-
240,276	565,571	1,621,293	1,669,933	-0-	2,361,486	12,401,425	-0-
468,369	11	244,919	23,071,744	-0-	15,775	1,667,965	731,185
357,000	108,565	23,464	7,224,379	656	3,728,828	171,622	1,277,276
-0-	57,294	285,946	-0-	-0-	1,522,019	-0-	-0-
211,857	10,229	672,540	6,329,164	1,877	439,245	147,651	844,463
-0-	-0-	151,349	-0-	-0-	549,086	-0-	-0-
30,396	4,399	3,938	-0-	-0-	49,661	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	8,424	4,059	-0-	-0-	16,491	-0-	-0-
-0-	28,093	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
155,874	193,410	143,426	4,927,470	1,459,759	377,055	1,342,342	650,839
<u>2,860,886</u>	<u>2,269,436</u>	<u>5,085,420</u>	<u>96,321,708</u>	<u>2,380,950</u>	<u>12,238,985</u>	<u>70,383,382</u>	<u>3,503,763</u>
<u>\$ 54,641,918</u>	<u>\$ 139,319,425</u>	<u>\$ 159,229,919</u>	<u>\$ 3,504,385,864</u>	<u>\$ 984,238,278</u>	<u>£ 798,905,194</u>	<u>\$1,302,674,084</u>	<u>\$ 684,180,114</u>

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)

31. Mai 2021

AB SICAV I

	Global Core Equity Portfolio (USD)	Global Income Portfolio (USD)	Alternative Risk Premia Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 1,727,420,233	\$ 103,496,760	\$ 53,290,875
Termineinlagen	5,931,558	3,961,743	2,610,703
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	3,359,922	286,446	374,492
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	14,583,928	1,360	-0-
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	-0-	3,461,739	11,720,328
Dividenden- und Zinsforderungen	2,846,750	1,300,792	116,909
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	1,051,195	168,299	671,303
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	-0-	270,635	1,163,956
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	-0-	360,770	18
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	-0-	131,637	189,628
Zinsforderungen aus Swaps	-0-	37,039	19,951
Forderungen aus der Wertpapierleihe	117,029	-0-	-0-
Abgegrenzte Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	48,856	53,153
	<u>1,755,310,615</u>	<u>113,526,076</u>	<u>70,211,316</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	19,140,563	317,239	566,222
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	67,596	234,746	4,473,131
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	1,343,996	478,711	1,910
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	1,401,591	618,130	1,081,418
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	-0-	1,761,399	1,798,819
Zu zahlende Dividenden	719,118	162,687	547,088
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	-0-	1,089,421	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	-0-	20,443	772,722
Verbindlichkeiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte	-0-	3,143,808	-0-
Zinsaufwand für Swaps	-0-	30,412	50,269
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	1,457,412	204,746	232,652
	<u>24,130,276</u>	<u>8,061,742</u>	<u>9,524,231</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 1,731,180,339</u>	<u>\$ 105,464,334</u>	<u>\$ 60,687,085</u>

[^] Einschließlich Beitrag zu eingeschränkter Clearing-Reserve (gemäß Definition im Angebotsdokument) in Höhe von CNY 469,658 (CNH 470,466). Siehe Anmerkung Q.

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)		Low Volatility Total Return Equity Portfolio (USD)	
€	642,041,374	€	825,034,853	\$	6,025,619,031	\$	1,137,322,767	CNH	1,959,429,960	\$	205,033,362	\$	118,786,758
	10,043,458		28,144,740		356,167,610		163,073,191		170,939		82,065		1,580,641
	20,202,414		815,165		-0-		289,212,906		-0-		7,185,199		3,977,026
	9,985,169		4,129,508		43,801,141		15,921,359		2,835,172		251,700		63,869
	-0-		-0-		-0-		26,651,190		37,661,203^		277		6,586,263
	2,815,757		2,916,130		1,741,216		8,860,495		333,868		2,001,692		252,687
	244,704		478,712		156,933		4,451,026		762		258,618		33,444
	-0-		-0-		-0-		2,637,452		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		11,235,046		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		764,483		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		1,518,399		-0-		-0-		-0-
	31,811		96,953		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		-0-		1,158,025		20,036		100,507
	685,364,687		861,616,061		6,427,485,931		1,661,648,314		2,001,589,929		214,832,949		131,381,195
	6,805,250		1,025,659		-0-		282,472,241		-0-		6,116,883		1,521,937
	2,832,288		1,727,701		10,776,828		3,961,896		230,077		-0-		-0-
	6,435,374		2,965,721		24,730,896		5,069,948		66,471		705,448		49,365
	326,717		15,821		576,347		5,177,964		94,464		1,528,395		881,148
	-0-		-0-		-0-		16,317,865		-0-		-0-		-0-
	367,531		589,278		647,211		7,783,273		554		857,485		24,976
	-0-		-0-		-0-		9,739,943		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		1,701,760		-0-		-0-		6,774,208
	-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		840,568		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		523,321		-0-		-0-		-0-
	657,375		1,126,188		6,219,958		2,478,639		1,619,858		131,846		162,745
	17,424,535		7,450,368		42,951,240		336,067,418		2,011,424		9,340,057		9,414,379
€	667,940,152	€	854,165,693	\$	6,384,534,691	\$	1,325,580,896	CNH	1,999,578,505	\$	205,492,892	\$	121,966,816

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)

31. Mai 2021

AB SICAV I

	Sustainable Global Thematic Credit Portfolio (EUR)		Event Driven Portfolio (USD)		Arya European Alpha Portfolio (EUR)	
VERMÖGENSWERTE						
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	€	29,261,834	\$	116,253,145	€	-0-
Termineinlagen.		582,339		6,889,836		168,539,727
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren		296,810		3,682		-0-
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital		-0-		-0-		-0-
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel		50,501		44,456,523		1,949,072
Dividenden- und Zinsforderungen.		228,151		-0-		-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften		211,525		15,756		23,371
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps		-0-		8,455,882		7,377,518
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren		-0-		-0-		-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten		13,105		-0-		-0-
Zinsforderungen aus Swaps		-0-		144,977		76,244
Forderungen aus der Wertpapierleihe		-0-		-0-		-0-
Abgegrenzte Gründungskosten		-0-		-0-		19,385
Sonstige Forderungen		27,118		-0-		63,581
		<u>30,671,383</u>		<u>176,219,801</u>		<u>178,048,898</u>
VERBINDLICHKEITEN						
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere		314,640		239,051		-0-
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar		118,839		280,784		3,489,340
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital		-0-		-0-		45,750
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften		90,248		246,634		13,881
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps		-0-		9,863,578		3,996,649
Zu zahlende Dividenden		74,865		-0-		-0-
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren		-0-		-0-		-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten		4,324		-0-		-0-
Verbindlichkeiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte		-0-		-0-		-0-
Zinsaufwand für Swaps		-0-		299,286		312,015
Verkaufte Optionen, zum Marktwert		-0-		-0-		-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten.		70,033		205,861		207,915
		<u>672,949</u>		<u>11,135,194</u>		<u>8,065,550</u>
NETTOVERMÖGEN	€	29,998,434	\$	165,084,607	€	169,983,348

* 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, und die Anlageaktivität innerhalb des US High Yield Portfolio, die sich auf seine Anlage im Financial Credit Portfolio bezieht, wurde aus Präsentationsgründen nicht in die kombinierten Finanzdaten aufgenommen.

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Kombiniert (USD)
\$ 35,967,838,911*
1,448,879,047
589,438,089
395,880,839
276,820,057
123,865,081*
70,624,154
34,307,587
28,648,466
4,232,066
3,408,808
351,349
131,534
1,422,659
38,945,848,647*
718,315,630
145,476,471
140,372,696
59,522,764
55,016,553
35,552,143*
18,876,859
11,517,084
4,984,844
3,233,328
763,475
87,465,923
1,281,097,770*
\$ 37,664,750,877*

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS**Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021****AB SICAV I**

	International Health Care Portfolio (USD)	International Technology Portfolio (USD)	Global Real Estate Securities Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Dividenden, netto	\$ 15,528,336	\$ 3,603,681	\$ 1,156,605
Zinsen	4,881	-0-	740
Swap-Erträge	-0-	-0-	-0-
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	67,269	262,035	3,987
	<u>15,600,486</u>	<u>3,865,716</u>	<u>1,161,332</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	22,323,018	16,311,576	495,594
Leistungsgebühr	-0-	-0-	-0-
Aufwendungen für Swaps	-0-	-0-	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	667,034	557,818	19,693
Transferstelle	659,345	680,103	42,932
Steuern	697,596	597,712	19,423
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	338,671	286,552	65,592
Depotbankgebühren	147,476	88,245	17,772
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	193,150	156,471	32,942
Vertriebsgebühr	345,594	481,514	13,380
Druckkosten	27,379	78,798	-0-
Dividendenaufwand	-0-	-0-	-0-
Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Zinsaufwand	-0-	-0-	-0-
Sonstige Aufwendungen	149,075	103,901	41,867
	<u>25,548,338</u>	<u>19,342,690</u>	<u>749,195</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	-0-	-0-	(41,536)
Nettoaufwendungen	<u>25,548,338</u>	<u>19,342,690</u>	<u>707,659</u>
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>(9,947,852)</u>	<u>(15,476,974)</u>	<u>453,673</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	81,793,366	224,158,631	570,459
Kapitalertragsteuer	(33)	-0-	-0-
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	214,124,604	209,618,144	11,876,086
Aus Finanzterminkontrakten	-0-	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften	(3,121)	41,496	(552)
Aus Swaps	-0-	-0-	-0-
Aus verkauften Optionen	-0-	-0-	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>285,966,964</u>	<u>418,341,297</u>	<u>12,899,666</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	455,198,038	402,324,871	(7,341,656)
Ausschüttungen	(341,944)	-0-	(300,332)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	1,107,523,108	667,246,788	41,743,039
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	<u>\$ 1,848,346,166</u>	<u>\$ 1,487,912,956</u>	<u>\$ 47,000,717</u>

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)
\$ 10,943,595	\$ 1,405,040	€ 535,427	\$ 1,160,355	\$ 21,240,032	CNH 2,947,221	\$ -0-	\$ 32,735,764
-0-	187	12,973,304	99	27,393,675	101,414,410	51,107,995	-0-
-0-	-0-	32,419	-0-	376,586	919,319	6,092,550	-0-
41,350	-0-	-0-	21	2,684	-0-	-0-	2,946
10,984,945	1,405,227	13,541,150	1,160,475	49,012,977	105,280,950	57,200,545	32,738,710
20,517,378	2,669,105	1,433,817	1,075,660	15,962,718	28,431,871	10,118,227	29,203,802
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	6,133,632
-0-	-0-	3,673	-0-	4,127,434	3,093,806	2,631,107	-0-
623,234	80,124	89,044	40,187	483,774	1,302,497	540,072	848,965
977,333	176,272	80,921	106,924	501,226	1,185,411	582,889	917,705
677,277	81,598	88,736	46,112	479,473	1,616,915	556,185	960,178
364,534	224,884	137,375	139,603	607,644	1,384,105	273,792	667,605
192,493	116,783	61,525	17,522	680,500	838,710	151,397	460,258
204,958	49,441	66,980	40,194	167,805	570,145	155,010	217,124
169,577	49,108	244	105	183,782	-0-	10,050	-0-
21,045	4,045	10,194	2,401	38,339	90,138	25,876	100,411
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	194	-0-	-0-	-0-
152,476	51,988	72,738	45,831	338,373	444,010	192,889	537,010
23,900,305	3,503,348	2,045,247	1,514,539	23,571,262	38,957,608	15,237,494	40,046,690
(15)	-0-	-0-	(107,215)	(41,344)	-0-	-0-	(14,031)
23,900,290	3,503,348	2,045,247	1,407,324	23,529,918	38,957,608	15,237,494	40,032,659
(12,915,345)	(2,098,121)	11,495,903	(246,849)	25,483,059	66,323,342	41,963,051	(7,293,949)
188,786,860	24,147,216	(4,035,680)	10,430,537	220,222,646	84,779,153	14,391,566	836,515,638
(4,296,455)	(4,400,784)	-0-	-0-	(1,657,831)	-0-	-0-	-0-
320,720,771	64,768,088	36,812,273	40,291,872	225,356,182	(125,747,935)	69,524,331	373,018,539
-0-	-0-	(154,850)	-0-	4,251,857	(1,448,650)	(125,852)	-0-
7,754,858	(6,825)	(655,580)	(88,218)	(11,346,258)	82,995,321	(139,244)	(560,562)
-0-	-0-	58,067	-0-	(19,518,036)	4,191,480	1,279,761	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	419,670	-0-	-0-	-0-
500,050,689	82,409,574	43,520,133	50,387,342	443,211,289	111,092,711	126,893,613	1,201,679,666
1,730,936,406	(58,652,570)	(35,601,464)	63,393,443	(358,460,734)	4,055,688,161	227,992,491	(1,094,130,398)
(1,200,468)	(9,168)	(1,501,557)	-0-	(40,114,176)	(62,898,144)	(7,878,625)	(22,656)
837,582,384	133,252,453	348,813,401	53,359,648	1,174,457,925	1,300,605,621	1,002,110,030	3,465,598,265
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
\$ 3,067,369,011	\$ 157,000,289	€ 355,230,513	\$ 167,140,433	\$ 1,219,094,304	CNH 5,404,488,349	\$ 1,349,117,509	\$ 3,573,124,877

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

(Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021

AB SICAV I

	Global Plus Fixed Income Portfolio (USD)	Select Absolute Alpha Portfolio (USD)	Emerging Market Local Currency Debt Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Dividenden, netto	\$ 1,205,424	\$ 5,089,650	\$ -0-
Zinsen	20,301,798	161,425	17,150,511
Swap-Erträge	476,057	10,095	148,364
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	-0-	25,020	-0-
	<u>21,983,279</u>	<u>5,286,190</u>	<u>17,298,875</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	5,336,392	10,099,650	409,631
Leistungsgebühr	-0-	31,614,276	-0-
Aufwendungen für Swaps	42,121	96,806	225,502
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	155,055	285,844	7,685
Transferstelle	277,961	383,992	23,476
Steuern	227,276	292,557	28,558
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	297,512	239,269	91,023
Depotbankgebühren	284,304	231,186	213,234
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	137,786	119,100	64,952
Vertriebsgebühr	1,055	-0-	-0-
Druckkosten	22,008	21,755	4,212
Dividendenaufwand	-0-	-0-	-0-
Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Zinsaufwand	-0-	-0-	-0-
Sonstige Aufwendungen	148,984	238,475	152,467
	<u>6,930,454</u>	<u>43,622,910</u>	<u>1,220,740</u>
Rückertstattete oder erlassene Aufwendungen	(78,556)	(62,742)	(361,315)
Nettoaufwendungen	<u>6,851,898</u>	<u>43,560,168</u>	<u>859,425</u>
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>15,131,381</u>	<u>(38,273,978)</u>	<u>16,439,450</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	4,476,081	148,767,994	1,236,106
Kapitalertragsteuer	-0-	-0-	(64,559)
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	14,693,084	60,968,331	4,293,776
Aus Finanzterminkontrakten	(652,371)	(1,101,700)	(10,945)
Aus Devisentermingeschäften	(1,385,002)	(9,274,768)	1,244,847
Aus Swaps	2,609,498	(716,744)	(1,102,386)
Aus verkauften Optionen	(146,315)	-0-	(204,978)
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>34,726,356</u>	<u>160,369,135</u>	<u>21,831,311</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(80,244,835)	(23,907,446)	(15,021,462)
Ausschüttungen	(1,093,532)	-0-	(17,795,374)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	1,057,002,284	767,298,408	269,329,486
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	<u>\$ 1,010,390,273</u>	<u>\$ 903,760,097</u>	<u>\$ 258,343,961</u>

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)
\$ 54,068	\$ -0-	\$ 161,015	\$ 56,072,960	\$ 20,162,737	£ 636,946	\$ 6,026,692	\$ 5,343,479
1,593,021	7,192,935	8,259,941	-0-	6,549	17,567,536	1,620	-0-
27,418	6,647	1,118,207	-0-	-0-	535,930	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	315,801	904	-0-	392,838	221,218
1,674,507	7,199,582	9,539,163	56,388,761	20,170,190	18,740,412	6,421,150	5,564,697
466,180	161,968	214,188	42,342,672	248,030	533,092	8,108,938	7,324,690
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
37,113	17,222	211,478	-0-	-0-	248,456	-0-	-0-
18,686	17,650	10,149	1,420,913	57,746	44,877	343,557	193,120
31,326	17,237	19,996	1,656,066	84,348	79,894	319,480	173,392
21,113	19,498	22,180	1,425,582	98,167	86,015	362,569	207,131
94,130	124,271	96,262	483,801	391,512	103,833	335,607	210,042
59,840	49,471	59,326	444,745	249,861	194,130	85,306	124,760
32,828	44,232	46,693	217,124	135,294	111,278	146,775	126,049
21,084	-0-	-0-	132,287	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	2,233	954	106,376	31,939	15,999	23,866	8,750
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
25,324	53,063	27,918	566,798	236,880	94,098	134,795	82,672
807,624	506,845	709,144	48,796,364	1,533,777	1,511,672	9,860,893	8,450,606
(125,337)	(105,053)	(199,850)	-0-	-0-	(1,203)	(386,208)	(219,446)
682,287	401,792	509,294	48,796,364	1,533,777	1,510,469	9,474,685	8,231,160
992,220	6,797,790	9,029,869	7,592,397	18,636,413	17,229,943	(3,053,535)	(2,666,463)
1,704,133	3,991,342	3,850,968	391,617,007	96,157,928	30,548,559	143,546,341	160,845,018
(18,943)	-0-	-0-	-0-	(937,050)	(2,889)	-0-	-0-
628,742	7,082,553	10,985,747	462,060,339	236,909,552	(37,979,748)	209,286,393	122,750,298
(67,639)	(1,758)	5,831	-0-	-0-	(457,355)	-0-	-0-
(67,991)	13,445	(6,606)	(1,149,755)	(4,608)	11,468,539	(1,624,931)	1,105,005
121,124	64,282	(50,366)	-0-	-0-	4,031,557	-0-	-0-
-0-	83,232	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
3,291,646	18,030,886	23,815,443	860,119,988	350,762,235	24,838,606	348,154,268	282,033,858
35,204,177	19,582,252	24,411,977	(1,103,328,816)	(666,961,693)	(91,686,716)	58,469,172	(217,214,702)
(1,849,738)	(72,364)	(7,573,959)	(80,670,873)	(17,287)	(2,565,877)	(735,646)	(844,428)
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
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
\$ 54,641,918	\$ 139,319,425	\$ 159,229,919	\$ 3,504,385,864	\$ 984,238,278	£ 798,905,194	\$ 1,302,674,084	\$ 684,180,114

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

(Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021

AB SICAV I

	Global Core Equity Portfolio (USD)	Global Income Portfolio (USD)	Alternative Risk Premia Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Dividenden, netto	\$ 20,889,709	\$ 128,032	\$ 256,493
Zinsen	387	5,288,567	230,056
Swap-Erträge	-0-	471,044	177,677
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	421,237	-0-	3,216
	<u>21,311,333</u>	<u>5,887,643</u>	<u>667,442</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	7,033,081	439,692	24,892
Leistungsgebühr	-0-	-0-	-0-
Aufwendungen für Swaps	-0-	271,740	215,781
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	175,330	27,375	6,145
Transferstelle	242,695	18,041	10,139
Steuern	245,744	27,799	6,435
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	346,680	144,398	57,948
Depotbankgebühren	216,506	88,239	206,568
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	175,654	41,520	34,544
Vertriebsgebühr	-0-	-0-	-0-
Druckkosten	37,286	2,341	1,574
Dividendenaufwand	-0-	-0-	4,767
Gründungskosten	-0-	-0-	-0-
Zinsaufwand	-0-	-0-	-0-
Sonstige Aufwendungen	209,779	49,421	61,978
	<u>8,682,755</u>	<u>1,110,566</u>	<u>630,771</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	-0-	(180,350)	(304,003)
Nettoaufwendungen	8,682,755	930,216	326,768
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>12,628,578</u>	<u>4,957,427</u>	<u>340,674</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	148,189,560	(3,094,914)	7,286,712
Kapitalertragsteuer	-0-	(858)	-0-
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	282,503,474	6,162,653	3,859,458
Aus Finanzterminkontrakten	-0-	(8,473)	258,438
Aus Devisentermingeschäften	(1,948,864)	(30,480)	(1,511,988)
Aus Swaps	-0-	906,102	(573,195)
Aus verkauften Optionen	-0-	-0-	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>441,372,748</u>	<u>8,891,457</u>	<u>9,660,099</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	267,431,122	9,200,676	10,552,388
Ausschüttungen	(2,568,733)	(1,660,157)	(547,124)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	1,024,945,202	89,032,358	41,021,722
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	<u>\$1,731,180,339</u>	<u>\$ 105,464,334</u>	<u>\$ 60,687,085</u>

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)		Low Volatility Total Return Equity Portfolio (USD)	
€	16,793,442	€	27,422,699	\$	21,694,773	\$	13,705,446	CNH	23,050,948	\$	-0-	\$	2,186,189
	-0-		-0-		44,056		31,864,049		62,339		9,325,047		-0-
	-0-		-0-		-0-		8,830,588		-0-		-0-		-0-
	94,047		322,356		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-
	16,887,489		27,745,055		21,738,829		54,400,083		23,113,287		9,325,047		2,186,189
	3,589,594		7,537,398		56,617,886		17,293,552		1,141,012		197,208		965,265
	-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		3,042,506		7,617		-0-		-0-
	314,624		363,767		2,987,430		1,064,166		144,785		17,218		28,277
	228,270		256,261		1,803,683		752,338		112,667		28,524		32,437
	178,773		212,974		1,822,738		545,145		153,054		30,440		27,218
	225,395		296,618		780,102		418,259		1,385,892		113,732		190,914
	91,061		228,993		510,559		659,332		1,402,509		35,766		85,135
	85,978		133,717		217,124		171,999		370,894		53,185		46,669
	5,942		8,356		741,106		593,798		-0-		-0-		-0-
	12,108		29,489		387,413		6,895		58,345		3,256		1,499
	-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		-0-		15,976		-0-		283
	-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-
	171,088		362,578		503,328		135,750		722,505		74,451		107,443
	4,902,833		9,430,151		66,371,369		24,683,740		5,515,256		553,780		1,485,140
	-0-		(4,932)		-0-		(1,262)		(1,440,677)		(220,490)		(220,903)
	4,902,833		9,425,219		66,371,369		24,682,478		4,074,579		333,290		1,264,237
	11,984,656		18,319,836		(44,632,540)		29,717,605		19,038,708		8,991,757		921,952
	16,524,412		30,644,189		668,002,574		67,900,612		216,015,455		18,110,685		(38,002,013)
	-0-		-0-		-0-		97		-0-		-0-		-0-
	121,744,067		282,164,904		1,118,275,677		151,292,634		149,328,629		9,823,745		14,307,484
	(234,095)		(1,186,808)		-0-		(3,775,615)		-0-		-0-		12,815,915
	885,777		1,595,012		(6,647,321)		(3,079,328)		(93,394)		(4,589)		(77,602)
	-0-		-0-		-0-		(4,569,590)		-0-		-0-		-0-
	-0-		-0-		-0-		991,988		-0-		-0-		-0-
	150,904,817		331,537,133		1,734,998,390		238,478,403		384,289,398		36,921,598		(10,034,264)
	123,972,416		(709,461,921)		(175,108,393)		(77,983,038)		641,986,819		(26,266,755)		(21,972,100)
	(3,668,701)		(588,871)		(7,526,875)		(91,201,657)		(7,238)		(7,681,788)		(418,537)
	396,731,620		1,232,679,352		4,832,171,569		1,256,287,188		973,309,526		202,519,837		154,391,717
	-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-		-0-
€	667,940,152	€	854,165,693	\$	6,384,534,691	\$	1,325,580,896	CNH	1,999,578,505	\$	205,492,892	\$	121,966,816

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

(Fortsetzung)

Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021

AB SICAV I

	Sustainable Global Thematic Credit Portfolio (EUR)	Event Driven Portfolio (USD)	Arya European Alpha Portfolio (EUR)(a)
ANLAGEERTRÄGE			
Dividenden, netto	€ 41	\$ 547,291	€ -0-
Zinsen	614,825	58,561	-0-
Swap-Erträge	-0-	980,177	1,209,116
Erträge aus der Wertpapierleihe, netto	-0-	-0-	-0-
	614,866	1,586,029	1,209,116
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	101,265	1,113,923	155,700
Leistungsgebühr	-0-	-0-	-0-
Aufwendungen für Swaps	-0-	1,484,281	1,319,145
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	4,615	14,910	1,771
Transferstelle	7,235	574	6,536
Steuern	5,132	15,039	7,843
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	47,422	37,499	143,397
Depotbankgebühren	37,862	42,569	53,042
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	24,807	41,899	24,112
Vertriebsgebühr	-0-	-0-	-0-
Druckkosten	372	516	1,445
Dividendenaufwand	-0-	59,528	-0-
Gründungskosten	1,551	3,976	2,596
Zinsaufwand	-0-	-0-	-0-
Sonstige Aufwendungen	22,532	37,946	394,327
	252,793	2,852,660	2,109,914
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	(108,767)	-0-	(223,153)
Nettoaufwendungen	144,026	2,852,660	1,886,761
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	470,840	(1,266,631)	(677,645)
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	1,422,777	21,217,612	(2,117,607)
Kapitalertragsteuer	-0-	-0-	-0-
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	(1,044,775)	4,397,813	-0-
Aus Finanzterminkontrakten	1,850	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften	(99,655)	(1,470,452)	9,490
Aus Swaps	-0-	(1,807,767)	3,380,869
Aus verkauften Optionen	-0-	-0-	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	751,037	21,070,575	595,107
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	10,707,182	6,465,089	169,388,241
Ausschüttungen	(75,186)	-0-	-0-
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	18,615,401	137,548,943	-0-
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	€ 29,998,434	\$ 165,084,607	€ 169,983,348

(a) Die Finanzinformationen für das Arya European Alpha Portfolio beziehen sich auf den Zeitraum vom 7. Oktober 2020 bis zum 31. Mai 2021. Siehe Anmerkung A.

* 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 the 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 Asia Income Opportunities Portfolio bezieht, wurde aus Präsentationsgründen nicht in die kombinierten Finanzdaten aufgenommen.

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Kombiniert (USD)	
\$	297,042,584 *
	264,668,327
	21,544,518
	2,255,842
	<u>585,511,271 *</u>
	299,115,141
	37,747,908
	15,943,711
	11,985,240
	11,631,600
	10,637,138
	9,427,801
	7,262,222
	4,098,321
	2,759,688
	1,092,599
	64,295
	38,584
	194
	<u>6,281,021</u>
	418,085,463
	<u>(4,476,412)</u>
	413,609,051
	<u>171,902,220 *</u>
	3,586,398,949
	(11,398,127)
	4,731,397,395 *
	8,976,997
	7,368
	(11,454,658)
	<u>1,050,622</u>
	8,476,880,766 *
	(107,136,303)*
	(319,041,547)*
	29,149,877,908
	<u>464,170,053 *</u>
\$	<u><u>37,664,750,877 *</u></u>

	International Health Care Portfolio	International Technology Portfolio	Global Real Estate Securities Portfolio
KLASSE			
A	2,433,740	952,757	784,313
A AUD H	-0-	5,575	-0-
A EUR H	58,249	-0-	-0-
A PLN H	-0-	163,119	-0-
AD	50,317	-0-	301,272
AD AUD H	-0-	-0-	137,518
AD NZD H	-0-	-0-	38,227
AD SGD H	-0-	-0-	4,854
AX	9,375	-0-	-0-
B	9,309	9,945	47,792
BD	-0-	-0-	2,731
BX	1,700	-0-	-0-
C	83,846	36,763	44,446
E	-0-	2,829,174	-0-
ED	1,364,509	-0-	-0-
I	453,750	701,171	323,977
I GBP	120,085	-0-	-0-
ID	-0-	-0-	70,388
S1	7,358	120,099	95,876
S14 GBP	1,721,973	-0-	-0-

	Sustainable Global Thematic Portfolio	India Growth Portfolio	Euro High Yield Portfolio
KLASSE			
A	11,267,630	470,382	73,663
A AUD H	778,888	-0-	-0-
A CAD H	1,212	-0-	-0-
A EUR H	1,670,530	-0-	-0-
A PLN H	-0-	2,070	-0-
A SGD H	887,320	10,557	-0-
A2	-0-	-0-	159,276
A2 CHF H	-0-	-0-	600
A2 PLN H	-0-	-0-	3,165
A2 USD H	-0-	-0-	4,332
AA	-0-	-0-	704,662
AA AUD H	-0-	-0-	21,278
AA HKD H	-0-	-0-	1,125
AA RMB H	-0-	-0-	1,033
AA SGD H	-0-	-0-	1,285
AA USD H	-0-	-0-	961,284
AD AUD H	-0-	32,435	-0-
AN	724	-0-	-0-
AR	-0-	-0-	1,081
AT	-0-	-0-	284,464
AT AUD H	-0-	-0-	1,020
AT SGD H	-0-	-0-	1,163
AT USD H	-0-	-0-	312,623
AX	5,526,520	272,003	-0-
AXX	20,422	-0-	-0-
B	9,985	914	-0-
B2	-0-	-0-	1,015
BX	134,100	18,785	-0-
BXX	27,266	-0-	-0-
C	123,332	1,748	2,693
C2	-0-	-0-	500
CT USD H	-0-	-0-	3,508
CX	16,937	-0-	-0-
E	204,971	-0-	-0-
E AUD H	10,448	-0-	-0-
I	5,542,569	28,251	2,000,290
I AUD	946,866	-0-	-0-
I AUD H	153,778	-0-	-0-
I EUR H	669,647	-0-	-0-
I2	-0-	-0-	3,153,453
I2 CHF H	-0-	-0-	600
I2 GBP H	-0-	-0-	467
I2 USD H	-0-	-0-	28,920
IN	647	-0-	-0-
IT USD H	-0-	-0-	158,491
IX	55,454	-0-	-0-
NT USD H	-0-	-0-	7,776
S	1,132,742	771	4,464,176
S GBP	169,712	-0-	-0-
S1	10,637,136	768	1,483,122
S1 AUD	81,602	-0-	-0-
S1 AUD H	48,561	-0-	-0-
S1 JPY	6,928,015	-0-	-0-
S1 USD H	-0-	-0-	667
SIX	197,240	-0-	-0-
SD	193,769	-0-	-0-
SX	1,341	-0-	-0-

	US Small and Mid-Cap Portfolio	Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	RMB Income Plus Portfolio
KLASSE			
A	1,562,446	6,006,871	-0-
A AUD H	156,835	203,541	-0-
A CAD H	-0-	14,828	-0-
A CHF H	-0-	2,587	-0-
A EUR H	119,821	697,740	-0-
A GBP H	-0-	129,830	-0-
A SGD H	-0-	137,123	-0-
A2	-0-	-0-	13,342,979
AD	-0-	30,936,091	-0-
AD AUD H	-0-	8,113,157	-0-
AD CAD H	-0-	1,491,657	-0-
AD EUR H	-0-	1,195,922	-0-
AD GBP H	-0-	1,956,169	-0-
AD RMB H	-0-	282,684	-0-
AD SGD H	-0-	3,319,070	-0-
AD ZAR H	-0-	1,514,410	-0-
AR	-0-	269,514	-0-
AR EUR	-0-	-0-	58,141
AR EUR H	-0-	180,701	-0-
AT	-0-	-0-	22,106,866
B	-0-	2,251	-0-
BD	-0-	60,284	-0-
C	134,214	306,548	-0-
C EUR H	2,550	-0-	-0-
C2	-0-	-0-	39,327
CT	-0-	-0-	140,894
ED	-0-	1,795,830	-0-
ED AUD H	-0-	327,534	-0-
ED ZAR H	-0-	716,019	-0-
I	1,095,635	1,816,524	-0-
I CHF H	-0-	4,387	-0-
I EUR H	166,485	123,930	-0-
I GBP	-0-	533	-0-
I GBP H	-0-	73,974	-0-
I2	-0-	-0-	4,466,678
ID	-0-	1,877,274	-0-
ID GBP H	-0-	1,014,470	-0-
IT	-0-	-0-	3,283,181
N	-0-	115,154	-0-
S	632	608,131	674
S EUR H	538	-0-	-0-
S GBP H	-0-	450	-0-
S1	252,583	10,646,061	2,114,203
S1 EUR H	538	-0-	-0-
S1 JPY	-0-	2,293	-0-
S1 JPY H	-0-	1,465	-0-
S1D	-0-	100,852	-0-
SD	-0-	398,708	-0-
W2	-0-	-0-	650

	Short Duration High Yield Portfolio	Select US Equity Portfolio	Global Plus Fixed Income Portfolio
KLASSE			
1.....	-0-	-0-	3,374,540
1 EUR H.....	-0-	-0-	13,587
1 GBP H.....	-0-	-0-	20,987
1D.....	-0-	-0-	1,601,363
1D EUR H.....	-0-	-0-	90,983
1D GBP H.....	-0-	-0-	172,912
2.....	-0-	-0-	3,383,189
2 EUR H.....	-0-	-0-	321,390
2 GBP H.....	-0-	-0-	515
A.....	-0-	10,744,868	-0-
A AUD H.....	-0-	596,380	-0-
A CHF H.....	-0-	45,311	-0-
A CZK H.....	-0-	4,022	-0-
A EUR H.....	-0-	5,118,089	-0-
A GBP H.....	-0-	278,463	-0-
A PLN H.....	-0-	5,278	-0-
A SGD H.....	-0-	102,888	-0-
A2.....	18,068,807	-0-	376,847
A2 CHF H.....	9,053	-0-	-0-
A2 EUR H.....	674,355	-0-	8,982
A2 GBP H.....	16,014	-0-	-0-
A2 SGD H.....	-0-	-0-	88,525
AA.....	233,903	-0-	-0-
AA AUD H.....	269,721	-0-	-0-
AA SGD H.....	1,289	-0-	-0-
AR.....	-0-	22,162	-0-
AR EUR H.....	4,188	6,897	632
AT.....	6,305,370	-0-	87,316
AT AUD H.....	96,624	-0-	886,512
AT CAD H.....	135,550	-0-	15,599
AT EUR H.....	611,065	-0-	9,514
AT GBP H.....	84,350	-0-	3,031
AT SGD H.....	133,660	-0-	81,023
B2.....	2,384	-0-	-0-
BT.....	3,426	-0-	-0-
BT CAD H.....	645	-0-	-0-
C.....	-0-	2,059,318	-0-
C2.....	3,883,144	-0-	1,251,058
C2 EUR H.....	-0-	-0-	507
CT.....	2,370,308	-0-	1,513
F.....	-0-	501,560	-0-
F EUR H.....	-0-	64,995	-0-
I.....	-0-	5,905,324	-0-
I CHF H.....	-0-	99,200	-0-
I EUR H.....	-0-	654,446	-0-
I GBP H.....	-0-	12,057	-0-
I SGD H.....	-0-	4,244	-0-
I2.....	17,612,543	-0-	8,807,736
I2 CHF H.....	668,191	-0-	-0-
I2 EUR H.....	1,388,816	-0-	25,526
I2 GBP H.....	92,120	-0-	433
IT.....	3,767,067	-0-	-0-
IT EUR H.....	648	-0-	-0-
IT GBP H.....	546	-0-	-0-
IT SGD H.....	1,178	-0-	-0-
N.....	-0-	1,280,932	-0-
N2.....	1,060,784	-0-	-0-
NT.....	786,369	-0-	-0-
S.....	1,112,277	2,039,546	2,535,905

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

31. Mai 2021

AB SICAV I

	Short Duration High Yield Portfolio	Select US Equity Portfolio	Global Plus Fixed Income Portfolio
KLASSE			
S CAD H	-0-	-0-	683,088
S EUR H	-0-	1,000	-0-
S GBP H	-0-	667	4,875
S1	4,183,322	27,511,137	19,914,378
S1 EUR H	-0-	705,218	400
S1 GBP H	-0-	667	-0-
S1 JPY	-0-	158,993	-0-
S1 JPY H	-0-	126,866	-0-
S1 SGD H	-0-	125	-0-
SA	-0-	-0-	257,056
W	-0-	7,769,698	-0-
W CHF H	-0-	206,566	-0-
W EUR H	-0-	3,144,532	-0-
W GBP H	-0-	7,809	-0-
W SGD H	-0-	2,333	-0-
W2 CHF H	142,811	-0-	-0-

	Select Absolute Alpha Portfolio	Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio
KLASSE			
A	7,838,357	-0-	-0-
A AUD H	733	-0-	-0-
A CHF H	18,160	-0-	-0-
A EUR H	3,441,651	-0-	-0-
A GBP H	168,235	-0-	-0-
A PLN H	3,074	-0-	-0-
A SGD H	110,076	-0-	-0-
A2	-0-	62,657	146,647
A2 AUD H	-0-	-0-	627
A2 CZK H	-0-	281	-0-
A2 EUR H	-0-	2,761	6,528
A2 PLN H	-0-	5,258	-0-
A2 SGD H	-0-	-0-	840
AA	-0-	34,050	434
AA AUD H	-0-	-0-	234
AA CAD H	-0-	-0-	227
AA EUR H	-0-	-0-	146
AA GBP H	-0-	-0-	134
AA SGD H	-0-	-0-	249
AR EUR H	-0-	-0-	774
AT	-0-	2,544	2,834,405
AT AUD H	-0-	-0-	737,809
AT CAD H	-0-	-0-	408,405
AT EUR H	-0-	-0-	99,670
AT GBP H	-0-	-0-	170,563
AT SGD H	-0-	1,320	16,378
BT AUD H	-0-	-0-	648
C	1,461,595	-0-	-0-
C2	-0-	-0-	667
C2 EUR H	-0-	-0-	636
F	91,282	-0-	-0-
F EUR H	21,866	-0-	-0-
I	3,828,029	-0-	-0-
I CHF H	122,416	-0-	-0-
I EUR H	5,534,342	-0-	-0-
I GBP H	92,301	-0-	-0-
I2	-0-	117,092	667
I2 EUR H	-0-	500	564
I2 SGD H	-0-	-0-	840
IT	-0-	-0-	1,080
IT AUD H	-0-	-0-	1,064
IT EUR H	-0-	-0-	747
IT SGD H	-0-	-0-	1,194
N	649,998	-0-	-0-
S	660	750	679
S EUR H	500	-0-	-0-
S GBP H	427	-0-	-0-
S1	28,574	1,852,860	667
S1 EUR H	4,766,099	-0-	-0-
S1 GBP H	427	-0-	-0-
S1 JPY H	656,491	-0-	-0-
S13 EUR H	314,212	-0-	-0-
SA	-0-	133,914	-0-
W	667	-0-	-0-
W CHF H	667	-0-	-0-
ZT	-0-	16,933,340	-0-

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

31. Mai 2021

AB SICAV I

	Emerging Market Corporate Debt Portfolio	US High Yield Portfolio	Low Volatility Equity Portfolio
KLASSE			
A	-0-	-0-	16,046,273
A AUD H	-0-	-0-	425,871
A EUR	-0-	-0-	762
A EUR H	-0-	-0-	864,784
A NZD H	-0-	-0-	149,697
A PLN H	-0-	-0-	3,594
A SGD H	-0-	-0-	930,313
A2	775,695	145,559	-0-
A2 AUD H	600	-0-	-0-
A2 CAD H	706	-0-	-0-
A2 EUR H	4,462	5,005	-0-
A2 GBP H	400	-0-	-0-
A2 SEK H	-0-	585,016	-0-
A2 SGD H	800	-0-	-0-
AA	1,058	-0-	-0-
AA AUD H	1,115	-0-	-0-
AA SGD H	1,369	-0-	-0-
AD	-0-	-0-	45,011,463
AD AUD H	-0-	-0-	8,606,100
AD CAD H	-0-	-0-	2,410,168
AD EUR H	-0-	-0-	1,141,650
AD GBP H	-0-	-0-	2,832,944
AD NZD H	-0-	-0-	1,763,012
AD RMB H	-0-	-0-	925,624
AD SGD H	-0-	-0-	13,461,410
AD ZAR H	-0-	-0-	61,639
AR	-0-	-0-	26,590
AR EUR	1,119	-0-	-0-
AR EUR H	-0-	-0-	707
AT	4,416	-0-	-0-
AT AUD H	964	-0-	-0-
AT CAD H	982	-0-	-0-
AT EUR H	705	-0-	-0-
AT GBP H	137	-0-	-0-
AT NZD H	1,309	-0-	-0-
AT RMB H	7,050	-0-	-0-
AT SGD H	1,165	-0-	-0-
C	-0-	-0-	3,001,392
C2	667	44,875	-0-
CT	923	-0-	-0-
ED	-0-	-0-	560,177
ED AUD H	-0-	-0-	258,876
ED ZAR H	-0-	-0-	291,675
I	-0-	-0-	7,856,335
I EUR	-0-	-0-	3,549
I EUR H	-0-	-0-	329,059
I GBP	-0-	-0-	1,778
I GBP H	-0-	-0-	155,352
I SGD H	-0-	-0-	61,732
I2	149,227	477,455	-0-
I2 EUR H	434	500	-0-
I2 SEK H	-0-	355,371	-0-
ID	-0-	-0-	311,269
IT	28,199	16,430	-0-
N	-0-	-0-	2,343,061
N2	146,559	43,661	-0-
NT	116,277	138,959	-0-
S	4,137,911	-0-	1,890,676

	Emerging Market Corporate Debt Portfolio	US High Yield Portfolio	Low Volatility Equity Portfolio
KLASSE			
S EUR H	-0-	-0-	8,616
S1	667	463	16,115,711
S1 EUR	-0-	-0-	90
S1 EUR H	-0-	31,607	45,832
S1D	-0-	-0-	297,058
SD	-0-	-0-	738,095
ZT	16,689	8,000,401	-0-

	Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	Global Dynamic Bond Portfolio	Concentrated US Equity Portfolio
KLASSE			
A	80,936	-0-	2,962,817
A AUD H	-0-	-0-	128,503
A EUR	-0-	-0-	505,905
A EUR H	-0-	-0-	77,932
A SGD H	-0-	-0-	345,420
A2 CHF H	-0-	667	-0-
A2 EUR H	-0-	2,267	-0-
A2 SGD H	-0-	933	-0-
A2 USD H	-0-	667	-0-
AD	39,845	-0-	-0-
AD AUD H	7,770	-0-	-0-
AD CAD H	5,632	-0-	-0-
AD EUR H	714	-0-	-0-
AD GBP H	509	-0-	-0-
AD NZD H	1,048	-0-	-0-
AD SGD H	963	-0-	-0-
AR EUR	-0-	-0-	76,643
AR EUR H	-0-	682	-0-
C	-0-	-0-	654,308
F	165,665	-0-	-0-
F EUR H	85	-0-	-0-
I	460,552	-0-	14,120,195
I AUD H	-0-	-0-	2,324
I CHF H	-0-	-0-	82,291
I EUR H	-0-	-0-	568,751
I GBP	-0-	-0-	1,599
I GBP H	500	-0-	120,439
I SGD H	999	-0-	4,397
I2	-0-	387	-0-
I2 CHF H	-0-	33,567	-0-
I2 EUR H	-0-	970,010	-0-
I2 USD H	-0-	667	-0-
N	-0-	-0-	154,226
S	6,353,257	26,295,929	3,711,228
S EUR	161,191	-0-	-0-
S EUR H	-0-	2,019,173	647,668
S GBP	17,951,144	-0-	-0-
S USD H	-0-	667	-0-
S1	543	997,375	5,040,719
S1 EUR H	-0-	467	500
S1 GBP H	-0-	-0-	603
S1 SGD H	-0-	400,551	-0-
S1 USD H	-0-	667	-0-
S1QD	-0-	241,335	-0-
SD	-0-	-0-	150,812
SQD	-0-	5,225,398	-0-

UMLAUFE NDE ANTEILE (Fortsetzung)

31. Mai 2021

AB SICAV I

	Concentrated Global Equity Portfolio	Global Core Equity Portfolio
KLASSE		
A	900,078	6,928,702
A AUD H	-0-	1,107
A EUR H	63,401	268,524
A SGD H	11,043	800
A2	-0-	-0-
A2 AUD H	-0-	-0-
AA	-0-	-0-
AA AUD H	-0-	-0-
AA CAD H	-0-	-0-
AA EUR H	-0-	-0-
AA GBP H	-0-	-0-
AA NZD H	-0-	-0-
AR EUR	642,985	751,414
AT	-0-	-0-
AT AUD H	-0-	-0-
AT CAD H	-0-	-0-
AT SGD H	-0-	-0-
C	21,301	8,323
I	5,229,586	5,376,043
I AUD H	-0-	1,373,275
I CAD H	7,735	-0-
I CHF H	5,664	593
I EUR	3,648,383	1,535
I EUR H	96,838	187,137
I GBP	191,152	-0-
I GBP H	28,070	117,533
I SGD H	-0-	800
I2	-0-	-0-
INN EUR	-0-	449,613
IT	-0-	-0-
IX EUR	-0-	152,170
N	30,363	84,616
RX EUR	-0-	10,910
S	805,743	8,066,388
S EUR H	500	467
S GBP	180,556	-0-
S GBP H	-0-	493,678
S NOK HP	-0-	91
S1	6,871,941	28,925,586
S1 EUR H	500	467
S1 NOK HP	-0-	243,194
SD	-0-	322,995
ZT	-0-	-0-

	Global Income Portfolio
KLASSE	
A	-0-
A EUR H	-0-
A2	538,474
A2 AUD H	867
A2 CAD H	867
A2 CHF H	667
A2 EUR H	1,753
A2 GBP H	533
A2 PLN H	24,210
A2 SGD H	36,648
AA	789,208
AA AUD H	128,398
AA CAD H	5,543
AA EUR H	1,348
AA SGD H	4,284
AD	-0-
AD EUR H	-0-
AT	756,241
AT AUD H	89,823
AT CAD H	69,686
AT EUR H	3,271
AT GBP H	7,415
AT SGD H	130,996
I	-0-
I2	68,851
I2 AUD H	867
I2 CAD H	867
I2 CHF H	667
I2 EUR H	613
I2 GBP H	520
I2 SGD H	933
IT	349,083
IT AUD H	1,009
IT CAD H	1,002
IT EUR H	656
IT SGD H	34,607
S	491,604
S EUR H	90
S GBP H	80
S1	100
S1 EUR H	90
S1 GBP H	80
S1D	-0-
S1D EUR H	-0-

	Alternative Risk Premia Portfolio	European Equity Portfolio
KLASSE		
A	-0-	3,123,454
A AUD H	-0-	8,504
A HKD H	-0-	46,906
A SGD H	-0-	35,501
A USD H	-0-	207,261
AD	-0-	103,797
AD AUD H	-0-	1,216,276
AD SGD H	-0-	138,950
AD USD H	-0-	758,781
B	-0-	731
BD AUD H	-0-	457
BD USD H	-0-	5,366
C	-0-	123,798
C USD H	-0-	3,771
F	100	-0-
F EUR H	90	-0-
F GBP H	80	-0-
I	33,820	11,193,244
I EUR H	25,830	-0-
I GBP	-0-	533
I GBP H	533	-0-
I USD H	-0-	26,489
S	29,609	13,588
S1	100	847,315
S1 EUR H	9,734	-0-
S1 GBP	-0-	63,929
S1 GBP H	80	-0-
S1X	-0-	4,798,682
S3 AUD H	710,883	-0-
SD	-0-	545,202

	Eurozone Equity Portfolio	American Growth Portfolio	All Market Income Portfolio
KLASSE			
A	1,910,321	10,956,416	610,240
A AUD H	156,516	-0-	-0-
A CHF H	-0-	-0-	730
A EUR H	-0-	364,286	1,178
A HKD	-0-	-0-	111,833
A PLN H	7,264	388,619	-0-
A SGD H	5,361	677,392	867
A USD H	320,460	-0-	-0-
A2X	-0-	-0-	37,433
AD	-0-	3,647,486	40,257,440
AD AUD H	-0-	1,999,962	12,282,575
AD CAD H	-0-	-0-	2,589,862
AD EUR H	-0-	-0-	1,667,752
AD GBP H	-0-	-0-	4,074,474
AD HKD	-0-	-0-	26,327,763
AD NZD H	-0-	-0-	2,412,731
AD RMB H	-0-	24,287	446,908
AD SGD H	-0-	-0-	170,823
AD ZAR H	-0-	1,635,674	2,706,356
AMG	-0-	-0-	754
AMG EUR H	-0-	-0-	680

	Eurozone Equity Portfolio	American Growth Portfolio	All Market Income Portfolio
KLASSE			
ANN	-0-	-0-	699
ANN EUR H	-0-	-0-	630
AQG	-0-	-0-	753
AQG EUR H	-0-	-0-	678
AR	2,335	-0-	-0-
AR EUR H	-0-	-0-	16,178
AX	638,719	102,292	185,706
B	-0-	55,048	6,622
B2X	-0-	-0-	693
BD	-0-	641	-0-
BD ZAR H	-0-	442	-0-
BX	62,415	1,647	3,314
C	259,134	1,438,580	70,559
C EUR H	-0-	31,777	-0-
C USD H	13,737	-0-	-0-
C2X	-0-	-0-	70,089
CD	-0-	-0-	3,815
CX	29,028	-0-	27,036
ED	-0-	2,690,094	5,094,583
ED AUD H	-0-	-0-	868,658
ED ZAR H	-0-	-0-	1,328,691
I	8,597,897	4,239,747	69,684
I CHF H	-0-	-0-	600
I EUR H	-0-	354,583	1,113
I GBP	533	5,620,591	-0-
I GBP H	-0-	48,155	-0-
I SGD H	-0-	-0-	867
I USD H	51,071	-0-	-0-
ID	-0-	-0-	75,961
IMG	-0-	-0-	754
IMG EUR H	-0-	-0-	680
INN	36,058	-0-	107,707
INN EUR H	-0-	-0-	639
INN GBP H	-0-	-0-	569
IQG	-0-	-0-	752
IQG EUR H	-0-	-0-	678
IX	2,576	-0-	-0-
N	-0-	228,165	39,563
ND	-0-	-0-	44,066
S	98,890	936,939	-0-
S1	9,371,375	6,518,951	10,082,109
S1 CHF H	-0-	-0-	100
S1 EUR H	-0-	107,073	36,700
S1 GBP	80	-0-	-0-
S1 GBPH	-0-	-0-	80
S1 USD H	4,130,318	-0-	-0-
S1D JPY H	-0-	-0-	549,635
S1N	81,665	-0-	-0-
S1N USD	197,698	-0-	-0-
S1QG GBPH	-0-	-0-	90
SD	-0-	201,036	-0-
SK	-0-	7,814,186	-0-

	China A Shares Equity Portfolio
KLASSE	
A	9,870
A AUD H	1,000
A CAD H	867
A EUR	600
A HKD H	776
A NZD H	1,000
A SGD H	933
A USD	3,417
A USD H	667
A2	-0-
AD HKD	804
AD HKD H	788
AD SGD H	942
AD USD H	680
I	670
I GBP	55,084
I USD H	67,547
I2	-0-
S	473,704
S USD	38,877
S1	67
S1 EUR	126,588
S1 GBP	405,550
SA	-0-
SP1 USD	771,777

	Financial Credit Portfolio	Low Volatility Total Return Equity Portfolio	Sustainable Global Thematic Credit Portfolio
KLASSE			
A	-0-	394,195	-0-
A AUD H	-0-	987	-0-
A CAD H	-0-	887	-0-
A EUR H	-0-	600	-0-
A GBP H	-0-	2,587	-0-
A HKD	-0-	11,649	-0-
A NZD H	-0-	1,040	-0-
A PLN H	-0-	385,235	-0-
A SGD H	-0-	119,822	-0-
A2	196,444	-0-	1,568
A2 CHF H	667	-0-	-0-
A2 EUR H	82,905	-0-	-0-
AD	-0-	245,655	-0-
AD AUD H	-0-	67,726	-0-
AD CAD H	-0-	2,197	-0-
AD GBP H	-0-	31,566	-0-
AD HKD	-0-	129,850	-0-
AD NZD H	-0-	1,095	-0-
AD SGD H	-0-	53,469	-0-
AT	738	-0-	-0-
I	-0-	183,404	-0-
I EUR H	-0-	600	-0-
I PLN H	-0-	420	-0-
I2	47,331	-0-	5,571
I2 CHF H	667	-0-	-0-
I2 EUR H	1,685,660	-0-	-0-

	Financial Credit Portfolio	Low Volatility Total Return Equity Portfolio	Sustainable Global Thematic Credit Portfolio
KLASSE			
I2 GBP H	533	-0-	921
I2 USD H	-0-	-0-	31,904
INN AUD H	-0-	-0-	908,163
IT	3,833	-0-	-0-
S	100	100	9,875
S EUR H	90	-0-	-0-
S GBP H	80	-0-	-0-
S1	100	100	174,820
S1 EUR H	90	-0-	-0-
S1 GBPH	80	-0-	80
S1 JPY H	-0-	1,128,333	-0-
S1 USD H	-0-	-0-	100
ZT	1,388,533	-0-	-0-

	Event Driven Portfolio
KLASSE	
A	-0-
I	667
S	77,334
S1	100
S1 EUR H	1,256,712
S1FN	-0-
S1FN GBP	-0-
S1FN USD	-0-
SU	1000

	Arya European Alpha Portfolio
KLASSE	
A	-0-
A USD H	-0-
A2	-0-
AT	-0-
F	1,528,439
F CHF H	64,537
F JPY	51,880
I	3,333
I GBP H	-0-
I USD H	-0-
I2	-0-
I2 EUR H	-0-
I2 GBP H	-0-
IT	-0-
S	1,207,322
S GBP H	52,078
S1	-0-
SU	1,469,254
Z	9,772,835
Z USD	255,773

International Health Care Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.....	<u>\$1,848,346,166</u>	<u>\$1,107,523,108</u>	<u>\$753,290,331</u>
Klasse			
A	<u>\$492.91</u>	<u>\$409.50</u>	<u>\$332.76</u>
A EUR H	<u>€20.12</u>	<u>€16.91</u>	<u>€14.18</u>
AD	<u>\$19.42</u>	<u>\$16.47</u>	<u>\$13.74</u>
AX	<u>\$562.31</u>	<u>\$464.83</u>	<u>\$375.84</u>
B	<u>\$371.04</u>	<u>\$311.33</u>	<u>\$255.52</u>
BX	<u>\$484.02</u>	<u>\$400.11</u>	<u>\$323.51</u>
C	<u>\$448.72</u>	<u>\$374.48</u>	<u>\$305.68</u>
ED	<u>\$21.60</u>	<u>\$18.34</u>	<u>\$15.31</u>
I	<u>\$589.96</u>	<u>\$486.24</u>	<u>\$391.97</u>
I GBP	<u>£18.57</u>	<u>£17.59</u>	<u>N/A</u>
S1	<u>\$198.60</u>	<u>\$163.37</u>	<u>\$131.28</u>
S14 GBP	<u>£121.68</u>	<u>£114.67</u>	<u>N/A</u>
A — EUR *	<u>€404.32</u>	<u>€368.91</u>	<u>€298.01</u>
B — EUR *	<u>€304.35</u>	<u>€280.47</u>	<u>€228.84</u>
C — EUR *	<u>€368.07</u>	<u>€337.36</u>	<u>€273.76</u>
I — EUR *	<u>€483.92</u>	<u>€438.05</u>	<u>€351.04</u>
S1 — EUR *	<u>€162.90</u>	<u>€147.18</u>	<u>N/A</u>

International Technology Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.....	<u>\$1,487,912,956</u>	<u>\$667,246,788</u>	<u>\$397,758,728</u>
Klasse			
A	<u>\$722.93</u>	<u>\$459.00</u>	<u>\$339.09</u>
A AUD H (1)	<u>AUD15.48</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
A PLN H	<u>PLN192.30</u>	<u>PLN124.17</u>	<u>PLN93.74</u>
B	<u>\$558.93</u>	<u>\$358.41</u>	<u>\$267.44</u>
C	<u>\$663.66</u>	<u>\$423.27</u>	<u>\$314.08</u>
E	<u>\$30.81</u>	<u>\$19.76</u>	<u>\$14.75</u>
I	<u>\$887.91</u>	<u>\$559.28</u>	<u>\$409.89</u>
S1	<u>\$423.22</u>	<u>\$265.91</u>	<u>\$194.11</u>
A — EUR *	<u>€592.99</u>	<u>€413.51</u>	<u>€303.68</u>
B — EUR *	<u>€458.47</u>	<u>€322.89</u>	<u>€239.51</u>
C — EUR *	<u>€544.38</u>	<u>€381.32</u>	<u>€281.28</u>
I — EUR *	<u>€728.32</u>	<u>€503.85</u>	<u>€367.09</u>

Global Real Estate Securities Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.	<u>\$47,000,717</u>	<u>\$41,743,039</u>	<u>\$45,899,751</u>
Klasse			
A	<u>\$29.76</u>	<u>\$22.06</u>	<u>\$26.00</u>
AD	<u>\$14.86</u>	<u>\$11.59</u>	<u>\$14.43</u>
AD AUD H	<u>AUD13.51</u>	<u>AUD10.70</u>	<u>AUD14.00</u>
AD NZD H	<u>NZD13.82</u>	<u>NZD10.92</u>	<u>NZD14.08</u>
AD SGD H	<u>SGD14.32</u>	<u>SGD11.22</u>	<u>SGD14.15</u>
B	<u>\$24.27</u>	<u>\$18.16</u>	<u>\$21.63</u>
BD	<u>\$14.85</u>	<u>\$11.60</u>	<u>\$14.43</u>
BD AUD H (2)	<u>N/A</u>	<u>AUD10.77</u>	<u>AUD14.08</u>
C	<u>\$23.10</u>	<u>\$17.19</u>	<u>\$20.36</u>
I	<u>\$35.04</u>	<u>\$25.76</u>	<u>\$30.13</u>
ID	<u>\$15.47</u>	<u>\$12.07</u>	<u>\$15.00</u>
S1	<u>\$27.59</u>	<u>\$20.19</u>	<u>\$23.51</u>
A — EUR *	<u>€24.41</u>	<u>€19.87</u>	<u>€23.29</u>
B — EUR *	<u>€19.91</u>	<u>€16.36</u>	<u>€19.37</u>
C — EUR *	<u>€18.95</u>	<u>€15.49</u>	<u>€18.23</u>
I — EUR *	<u>€28.74</u>	<u>€23.21</u>	<u>€26.98</u>
S1 — EUR *	<u>€22.63</u>	<u>€18.19</u>	<u>€21.06</u>

	Sustainable Global Thematic Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$3,067,369,011</u>	<u>\$837,582,384</u>	<u>\$726,183,042</u>
Klasse			
A	<u>\$42.29</u>	<u>\$29.19</u>	<u>\$25.10</u>
A AUD H	<u>AUD50.22</u>	<u>AUD35.03</u>	<u>AUD31.36</u>
A CAD H (3)	<u>CAD16.10</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
A EUR H	<u>€32.96</u>	<u>€23.09</u>	<u>€20.47</u>
A SGD H	<u>SGD33.55</u>	<u>SGD23.25</u>	<u>SGD20.27</u>
AN	<u>\$42.34</u>	<u>\$29.23</u>	<u>\$25.13</u>
AX	<u>\$123.97</u>	<u>\$85.58</u>	<u>\$73.57</u>
AXX	<u>\$141.36</u>	<u>\$97.09</u>	<u>\$83.05</u>
B	<u>\$33.00</u>	<u>\$23.01</u>	<u>\$19.98</u>
B AUD H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>AUD28.70</u>
B CAD H (4)	<u>N/A</u>	<u>CAD21.61</u>	<u>CAD19.22</u>
BX	<u>\$92.36</u>	<u>\$64.39</u>	<u>\$55.91</u>
BXX	<u>\$120.82</u>	<u>\$82.98</u>	<u>\$70.98</u>
C	<u>\$41.42</u>	<u>\$28.72</u>	<u>\$24.80</u>
CX	<u>\$113.04</u>	<u>\$78.38</u>	<u>\$67.68</u>
E (5)	<u>\$15.39</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
E AUD H (6)	<u>AUD15.11</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
I	<u>\$51.68</u>	<u>\$35.39</u>	<u>\$30.18</u>
I AUD (7)	<u>AUD15.92</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
I AUD H (8)	<u>AUD15.20</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
I EUR H	<u>€35.72</u>	<u>€24.81</u>	<u>€21.80</u>
IN	<u>\$51.70</u>	<u>\$35.40</u>	<u>\$30.19</u>
IX	<u>\$150.78</u>	<u>\$103.25</u>	<u>\$88.05</u>
S	<u>\$55.10</u>	<u>\$37.34</u>	<u>\$31.50</u>
S GBP	<u>£42.80</u>	<u>£33.33</u>	<u>£27.46</u>
S1	<u>\$50.81</u>	<u>\$34.68</u>	<u>\$29.45</u>
S1 AUD (9)	<u>AUD104.18</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
S1 AUD H (10)	<u>AUD102.70</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
S1 JPY (11)	<u>¥11,499.00</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
S1X	<u>\$164.75</u>	<u>\$112.44</u>	<u>\$95.50</u>
SD	<u>\$194.54</u>	<u>\$137.25</u>	<u>\$120.70</u>
SX	<u>\$182.76</u>	<u>\$123.86</u>	<u>\$104.46</u>
A — EUR *	<u>€34.69</u>	<u>€26.30</u>	<u>€22.48</u>
AX — EUR *	<u>€101.69</u>	<u>€77.10</u>	<u>€65.89</u>
B — EUR *	<u>€27.07</u>	<u>€20.73</u>	<u>€17.89</u>
BX — EUR *	<u>€75.76</u>	<u>€58.01</u>	<u>€50.07</u>
C — EUR *	<u>€33.98</u>	<u>€25.87</u>	<u>€22.21</u>
CX — EUR *	<u>€92.72</u>	<u>€70.61</u>	<u>€60.61</u>
I — EUR *	<u>€42.39</u>	<u>€31.88</u>	<u>€27.03</u>
IN — EUR *	<u>€42.41</u>	<u>€31.89</u>	<u>N/A</u>
IX — EUR *	<u>€123.68</u>	<u>€93.02</u>	<u>€78.86</u>
S — EUR *	<u>€45.20</u>	<u>€33.64</u>	<u>€28.21</u>
S1 — EUR *	<u>€41.68</u>	<u>€31.24</u>	<u>€26.37</u>
S1X — EUR *	<u>€135.14</u>	<u>€101.30</u>	<u>€85.53</u>
SX — EUR *	<u>€149.91</u>	<u>€111.58</u>	<u>€93.55</u>

India Growth Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.	<u>\$157,000,289</u>	<u>\$133,252,453</u>	<u>\$226,411,841</u>
Klasse			
A	<u>\$206.29</u>	<u>\$122.51</u>	<u>\$174.67</u>
A PLN H	<u>PLN112.09</u>	<u>PLN67.31</u>	<u>PLN97.81</u>
A SGD H	<u>SGD21.20</u>	<u>SGD12.64</u>	<u>SGD18.29</u>
AD AUD H	<u>AUD15.88</u>	<u>AUD9.69</u>	<u>AUD14.68</u>
AX	<u>\$185.21</u>	<u>\$109.77</u>	<u>\$156.14</u>
B	<u>\$192.83</u>	<u>\$115.66</u>	<u>\$166.55</u>
BX	<u>\$141.22</u>	<u>\$84.53</u>	<u>\$121.48</u>
C	<u>\$179.99</u>	<u>\$107.39</u>	<u>\$153.79</u>
I	<u>\$204.74</u>	<u>\$120.63</u>	<u>\$170.60</u>
S	<u>\$20.70</u>	<u>\$12.05</u>	<u>\$16.85</u>
S1	<u>\$21.65</u>	<u>\$12.73</u>	<u>\$17.97</u>
A — EUR *	<u>€169.21</u>	<u>€110.37</u>	<u>€156.43</u>
AX — EUR *	<u>€151.92</u>	<u>€98.89</u>	<u>€139.84</u>
B — EUR *	<u>€158.17</u>	<u>€104.20</u>	<u>€149.16</u>
BX — EUR *	<u>€115.84</u>	<u>€76.15</u>	<u>€108.80</u>
C — EUR *	<u>€147.64</u>	<u>€96.75</u>	<u>€137.73</u>
I — EUR *	<u>€167.94</u>	<u>€108.67</u>	<u>€152.79</u>

	Euro High Yield Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>€355,230,513</u>	<u>€348,813,401</u>	<u>€535,377,294</u>
Klasse			
A	<u>€16.99</u>	<u>€15.39</u>	<u>€16.20</u>
A2	<u>€27.87</u>	<u>€24.62</u>	<u>€25.29</u>
A2 CHF H	<u>CHF18.49</u>	<u>CHF16.35</u>	<u>CHF16.85</u>
A2 PLN H	<u>PLN110.11</u>	<u>PLN96.88</u>	<u>PLN98.77</u>
A2 USD H	<u>\$20.21</u>	<u>\$17.63</u>	<u>\$17.61</u>
AA	<u>€13.42</u>	<u>€12.34</u>	<u>€13.19</u>
AA AUD H	<u>AUD12.88</u>	<u>AUD11.89</u>	<u>AUD13.11</u>
AA HKD H	<u>HKD92.62</u>	<u>HKD84.98</u>	<u>HKD90.35</u>
AA RMB H	<u>CNH91.73</u>	<u>CNH83.95</u>	<u>CNH89.48</u>
AA SGD H	<u>SGD13.72</u>	<u>SGD12.56</u>	<u>SGD13.51</u>
AA USD H	<u>\$13.54</u>	<u>\$12.40</u>	<u>\$13.21</u>
AR	<u>€13.65</u>	<u>€12.55</u>	<u>€13.41</u>
AT	<u>€17.04</u>	<u>€15.43</u>	<u>€16.25</u>
AT AUD H	<u>AUD14.72</u>	<u>AUD13.38</u>	<u>AUD14.49</u>
AT SGD H	<u>SGD15.18</u>	<u>SGD13.69</u>	<u>SGD14.50</u>
AT USD H	<u>\$15.19</u>	<u>\$13.69</u>	<u>\$14.37</u>
B2	<u>€24.92</u>	<u>€22.23</u>	<u>€23.06</u>
C	<u>€16.99</u>	<u>€15.39</u>	<u>€16.20</u>
C2	<u>€26.53</u>	<u>€23.53</u>	<u>€24.27</u>
CT USD H	<u>\$15.12</u>	<u>\$13.63</u>	<u>\$14.31</u>
I	<u>€16.98</u>	<u>€15.38</u>	<u>€16.19</u>
I2	<u>€29.63</u>	<u>€26.03</u>	<u>€26.59</u>
I2 CHF H	<u>CHF19.24</u>	<u>CHF16.92</u>	<u>CHF17.35</u>
I2 GBP H	<u>£19.29</u>	<u>£16.83</u>	<u>£17.27</u>
I2 USD H	<u>\$21.64</u>	<u>\$18.78</u>	<u>\$18.67</u>
IT USD H	<u>\$15.17</u>	<u>\$13.68</u>	<u>\$14.34</u>
NT USD H	<u>\$15.17</u>	<u>\$13.68</u>	<u>\$14.35</u>
S	<u>€32.49</u>	<u>€28.32</u>	<u>€28.68</u>
S1	<u>€30.40</u>	<u>€26.65</u>	<u>€27.15</u>
S1 USD H	<u>\$22.44</u>	<u>\$19.43</u>	<u>\$19.26</u>
A — USD *	<u>\$20.71</u>	<u>\$17.08</u>	<u>\$18.09</u>
A2 — USD *	<u>\$33.98</u>	<u>\$27.33</u>	<u>\$28.24</u>
AT — USD *	<u>\$20.77</u>	<u>\$17.13</u>	<u>\$18.14</u>
B2 — USD *	<u>\$30.38</u>	<u>\$24.68</u>	<u>\$25.75</u>
C — USD *	<u>\$20.71</u>	<u>\$17.08</u>	<u>\$18.09</u>
C2 — USD *	<u>\$32.34</u>	<u>\$26.12</u>	<u>\$27.10</u>
I — USD *	<u>\$20.70</u>	<u>\$17.07</u>	<u>\$18.08</u>
I2 — USD *	<u>\$36.12</u>	<u>\$28.89</u>	<u>\$29.69</u>
S — USD *	<u>\$39.61</u>	<u>\$31.44</u>	<u>\$32.02</u>
S1 — USD *	<u>\$37.06</u>	<u>\$29.58</u>	<u>\$30.32</u>

US Small and Mid-Cap Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$167,140,433</u>	<u>\$53,359,648</u>	<u>\$83,198,889</u>
Klasse			
A	<u>\$46.71</u>	<u>\$26.55</u>	<u>\$31.46</u>
A AUD H	<u>AUD24.15</u>	<u>AUD14.03</u>	<u>N/A</u>
A EUR H	<u>€42.71</u>	<u>€24.70</u>	<u>€30.46</u>
A SGD H (12)	<u>N/A</u>	<u>SGD20.62</u>	<u>SGD25.02</u>
B (13)	<u>N/A</u>	<u>\$23.98</u>	<u>\$28.70</u>
C	<u>\$44.45</u>	<u>\$25.38</u>	<u>\$30.20</u>
C EUR H	<u>€40.79</u>	<u>€23.69</u>	<u>€29.34</u>
I	<u>\$51.13</u>	<u>\$28.84</u>	<u>\$33.89</u>
I EUR H	<u>€46.50</u>	<u>€26.68</u>	<u>€32.64</u>
S	<u>\$57.38</u>	<u>\$32.02</u>	<u>\$37.23</u>
S EUR H	<u>€52.18</u>	<u>€29.63</u>	<u>€35.87</u>
S1	<u>\$52.79</u>	<u>\$29.68</u>	<u>\$34.77</u>
S1 EUR H	<u>€48.10</u>	<u>€27.51</u>	<u>€33.55</u>
A — EUR *	<u>€38.31</u>	<u>€23.92</u>	<u>€28.18</u>
B — EUR *	<u>N/A</u>	<u>€21.60</u>	<u>€25.70</u>
C — EUR *	<u>€36.46</u>	<u>€22.86</u>	<u>€27.05</u>
I — EUR *	<u>€41.94</u>	<u>€25.98</u>	<u>€30.35</u>
S — EUR *	<u>€47.07</u>	<u>€28.85</u>	<u>€33.34</u>
S1 — EUR *	<u>€43.30</u>	<u>€26.74</u>	<u>€31.14</u>

	Emerging Markets Multi-Asset Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$1,219,094,304</u>	<u>\$1,174,457,925</u>	<u>\$1,854,347,221</u>
Klasse			
A	<u>\$19.82</u>	<u>\$14.35</u>	<u>\$14.89</u>
A AUD H	<u>AUD22.54</u>	<u>AUD16.55</u>	<u>AUD17.84</u>
A CAD H	<u>CAD21.47</u>	<u>CAD15.66</u>	<u>CAD16.61</u>
A CHF H	<u>CHF16.34</u>	<u>CHF12.04</u>	<u>CHF12.93</u>
A EUR H	<u>€17.00</u>	<u>€12.52</u>	<u>€13.40</u>
A GBP H	<u>£18.07</u>	<u>£13.20</u>	<u>£14.12</u>
A SGD H	<u>SGD21.41</u>	<u>SGD15.56</u>	<u>SGD16.37</u>
AD	<u>\$13.78</u>	<u>\$10.46</u>	<u>\$11.45</u>
AD AUD H	<u>AUD12.44</u>	<u>AUD9.59</u>	<u>AUD10.81</u>
AD CAD H	<u>CAD12.87</u>	<u>CAD9.85</u>	<u>CAD10.96</u>
AD EUR H	<u>€13.31</u>	<u>€10.21</u>	<u>€11.25</u>
AD GBP H	<u>£13.15</u>	<u>£10.08</u>	<u>£11.22</u>
AD RMB H	<u>CNH113.20</u>	<u>CNH86.03</u>	<u>CNH94.74</u>
AD SGD H	<u>SGD14.37</u>	<u>SGD10.95</u>	<u>SGD12.08</u>
AD ZAR H	<u>R99.25</u>	<u>R75.29</u>	<u>R84.09</u>
AR	<u>\$15.46</u>	<u>\$11.97</u>	<u>\$13.37</u>
AR EUR H	<u>€13.98</u>	<u>€10.91</u>	<u>€12.45</u>
B	<u>\$17.95</u>	<u>\$13.13</u>	<u>\$13.76</u>
BD	<u>\$13.85</u>	<u>\$10.53</u>	<u>\$11.53</u>
C	<u>\$18.96</u>	<u>\$13.79</u>	<u>\$14.37</u>
ED	<u>\$15.60</u>	<u>\$11.85</u>	<u>\$12.97</u>
ED AUD H	<u>AUD16.50</u>	<u>AUD12.72</u>	<u>N/A</u>
ED ZAR H	<u>R112.31</u>	<u>R85.23</u>	<u>N/A</u>
I	<u>\$21.51</u>	<u>\$15.45</u>	<u>\$15.90</u>
I CHF H	<u>CHF17.63</u>	<u>CHF12.89</u>	<u>CHF13.73</u>
I EUR H	<u>€18.48</u>	<u>€13.49</u>	<u>€14.33</u>
I GBP	<u>£16.96</u>	<u>£13.99</u>	<u>N/A</u>
I GBP H	<u>£19.54</u>	<u>£14.16</u>	<u>£15.03</u>
ID	<u>\$12.55</u>	<u>\$9.51</u>	<u>\$10.41</u>
ID GBP H	<u>£14.88</u>	<u>£11.39</u>	<u>£12.67</u>
N	<u>\$20.17</u>	<u>\$14.66</u>	<u>\$15.29</u>
S	<u>\$23.71</u>	<u>\$16.87</u>	<u>\$17.20</u>
S GBP H	<u>£24.03</u>	<u>£17.26</u>	<u>£18.14</u>
S1	<u>\$21.89</u>	<u>\$15.70</u>	<u>\$16.14</u>
S1 JPY	<u>¥12,573.00</u>	<u>¥8,852.00</u>	<u>¥9,144.00</u>
S1 JPY H	<u>¥11,759.00</u>	<u>¥8,490.00</u>	<u>¥8,935.00</u>
S1D	<u>\$102.29</u>	<u>\$77.54</u>	<u>\$84.81</u>
SD	<u>\$117.28</u>	<u>\$88.83</u>	<u>\$97.17</u>
SQD GBP H (14)	<u>N/A</u>	<u>£11.91</u>	<u>£13.22</u>
A — EUR *	<u>€16.26</u>	<u>€12.93</u>	<u>€13.34</u>
I — EUR *	<u>€17.64</u>	<u>€13.92</u>	<u>€14.24</u>

	RMB Income Plus Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.	<u>CNH5,404,488,349</u>	<u>CNH1,300,605,621</u>	<u>CNH1,495,869,447</u>
Klasse			
A2	<u>CNH145.34</u>	<u>CNH139.77</u>	<u>CNH136.41</u>
AR EUR	<u>€11.93</u>	<u>€11.83</u>	<u>€12.65</u>
AT	<u>CNH95.40</u>	<u>CNH95.94</u>	<u>CNH97.85</u>
C2	<u>CNH139.03</u>	<u>CNH134.31</u>	<u>CNH131.67</u>
CT	<u>CNH96.05</u>	<u>CNH96.57</u>	<u>CNH98.48</u>
I2	<u>CNH153.58</u>	<u>CNH146.89</u>	<u>CNH142.58</u>
IT	<u>CNH96.12</u>	<u>CNH96.70</u>	<u>CNH98.65</u>
S	<u>CNH165.05</u>	<u>CNH156.80</u>	<u>CNH151.10</u>
S1	<u>CNH156.17</u>	<u>CNH149.18</u>	<u>CNH144.54</u>
W2	<u>CNH114.75</u>	<u>CNH109.56</u>	<u>CNH106.17</u>
A2 — USD *	<u>\$22.86</u>	<u>\$19.58</u>	<u>\$19.67</u>
A2 — EUR *	<u>€18.75</u>	<u>€17.64</u>	<u>€17.61</u>
AT — USD *	<u>\$15.00</u>	<u>\$13.44</u>	<u>\$14.11</u>
C2 — USD *	<u>\$21.87</u>	<u>\$18.82</u>	<u>\$18.99</u>
CT — USD *	<u>\$15.11</u>	<u>\$13.53</u>	<u>\$14.20</u>
I2 — USD *	<u>\$24.16</u>	<u>\$20.58</u>	<u>\$20.56</u>
I2 — EUR *	<u>€19.81</u>	<u>€18.54</u>	<u>€18.41</u>
IT — USD *	<u>\$15.12</u>	<u>\$13.55</u>	<u>\$14.22</u>
S — USD *	<u>\$25.96</u>	<u>\$21.97</u>	<u>\$21.79</u>
S — EUR *	<u>€21.29</u>	<u>€19.79</u>	<u>€19.51</u>
S1 — USD *	<u>\$24.56</u>	<u>\$20.90</u>	<u>\$20.84</u>
S1 — EUR *	<u>€20.14</u>	<u>€18.83</u>	<u>€18.66</u>

	Short Duration High Yield Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$1,349,117,509</u>	<u>\$1,002,110,030</u>	<u>\$954,414,744</u>
Klasse			
A2	<u>\$22.44</u>	<u>\$20.13</u>	<u>\$19.92</u>
A2 CHF H	<u>CHF17.45</u>	<u>CHF15.86</u>	<u>CHF16.23</u>
A2 EUR H	<u>€19.82</u>	<u>€17.99</u>	<u>€18.33</u>
A2 GBP H	<u>£20.91</u>	<u>£18.86</u>	<u>£19.18</u>
A2 SEK H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>kr16.83</u>
AA	<u>\$13.13</u>	<u>\$12.43</u>	<u>\$12.97</u>
AA AUD H	<u>AUD12.64</u>	<u>AUD12.04</u>	<u>AUD12.83</u>
AA SGD H	<u>SGD13.56</u>	<u>SGD12.86</u>	<u>SGD13.48</u>
AR EUR H	<u>€13.44</u>	<u>€12.77</u>	<u>€13.60</u>
AT	<u>\$15.23</u>	<u>\$14.23</u>	<u>\$14.65</u>
AT AUD H	<u>AUD14.83</u>	<u>AUD13.95</u>	<u>AUD14.66</u>
AT CAD H	<u>CAD14.61</u>	<u>CAD13.70</u>	<u>CAD14.23</u>
AT EUR H	<u>€14.92</u>	<u>€13.98</u>	<u>€14.47</u>
AT GBP H	<u>£14.69</u>	<u>£13.80</u>	<u>£14.41</u>
AT SGD H	<u>SGD15.07</u>	<u>SGD14.11</u>	<u>SGD14.60</u>
B2	<u>\$20.35</u>	<u>\$18.43</u>	<u>\$18.41</u>
BT	<u>\$15.19</u>	<u>\$14.18</u>	<u>\$14.61</u>
BT CAD H	<u>CAD14.54</u>	<u>CAD13.63</u>	<u>CAD14.15</u>
C2	<u>\$21.47</u>	<u>\$19.34</u>	<u>\$19.22</u>
CT	<u>\$14.75</u>	<u>\$13.78</u>	<u>\$14.19</u>
I2	<u>\$23.68</u>	<u>\$21.12</u>	<u>\$20.78</u>
I2 CHF H	<u>CHF18.30</u>	<u>CHF16.54</u>	<u>CHF16.83</u>
I2 EUR H	<u>€20.89</u>	<u>€18.86</u>	<u>€19.13</u>
I2 GBP H	<u>£22.05</u>	<u>£19.79</u>	<u>£20.02</u>
IT	<u>\$14.90</u>	<u>\$13.92</u>	<u>\$14.33</u>
IT EUR H	<u>€14.65</u>	<u>€13.74</u>	<u>€14.21</u>
IT GBP H	<u>£15.32</u>	<u>£14.40</u>	<u>£15.00</u>
IT SGD H	<u>SGD15.50</u>	<u>SGD14.51</u>	<u>SGD15.02</u>
N2	<u>\$19.47</u>	<u>\$17.56</u>	<u>\$17.47</u>
NT	<u>\$14.60</u>	<u>\$13.64</u>	<u>\$14.05</u>
S	<u>\$25.45</u>	<u>\$22.55</u>	<u>\$22.04</u>
S1	<u>\$24.20</u>	<u>\$21.55</u>	<u>\$21.16</u>
S1QD EUR H (15)	<u>N/A</u>	<u>€95.05</u>	<u>N/A</u>
W2 CHF H	<u>CHF16.43</u>	<u>CHF14.83</u>	<u>CHF15.07</u>

Select US Equity Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$3,573,124,877</u>	<u>\$3,465,598,265</u>	<u>\$4,033,034,423</u>
Klasse			
A	<u>\$51.08</u>	<u>\$36.17</u>	<u>\$33.23</u>
A AUD H	<u>AUD25.28</u>	<u>AUD18.07</u>	<u>AUD17.46</u>
A CHF H	<u>CHF29.76</u>	<u>CHF21.40</u>	<u>CHF20.36</u>
A CZK H	<u>CZK1,413.06</u>	<u>CZK1,013.01</u>	<u>CZK960.03</u>
A EUR H	<u>€44.95</u>	<u>€32.20</u>	<u>€30.51</u>
A GBP H	<u>£46.61</u>	<u>£33.36</u>	<u>£31.75</u>
A PLN H	<u>PLN142.39</u>	<u>PLN101.69</u>	<u>PLN96.11</u>
A SGD H	<u>SGD47.78</u>	<u>SGD33.96</u>	<u>SGD31.72</u>
AR	<u>\$26.53</u>	<u>\$19.36</u>	<u>\$18.31</u>
AR EUR H	<u>€25.92</u>	<u>€18.97</u>	<u>€18.35</u>
C	<u>\$44.19</u>	<u>\$31.43</u>	<u>\$29.01</u>
F	<u>\$55.96</u>	<u>\$39.06</u>	<u>\$35.37</u>
F EUR H	<u>€48.55</u>	<u>€34.27</u>	<u>€31.99</u>
I	<u>\$55.13</u>	<u>\$38.72</u>	<u>\$35.30</u>
I CHF H	<u>CHF31.63</u>	<u>CHF22.56</u>	<u>CHF21.29</u>
I EUR H	<u>€48.55</u>	<u>€34.50</u>	<u>€32.43</u>
I GBP H	<u>£50.36</u>	<u>£35.74</u>	<u>£33.75</u>
I SGD H	<u>SGD38.29</u>	<u>SGD27.00</u>	<u>SGD25.02</u>
N	<u>\$42.22</u>	<u>\$30.03</u>	<u>\$27.72</u>
S	<u>\$61.68</u>	<u>\$42.84</u>	<u>\$38.60</u>
S EUR H	<u>€54.23</u>	<u>€38.09</u>	<u>€35.53</u>
S GBP H	<u>£56.48</u>	<u>£39.64</u>	<u>£37.00</u>
S1	<u>\$57.37</u>	<u>\$40.14</u>	<u>\$36.44</u>
S1 EUR H	<u>€50.94</u>	<u>€36.05</u>	<u>€33.70</u>
S1 GBP H	<u>£52.49</u>	<u>£37.11</u>	<u>£34.90</u>
S1 JPY	<u>¥14,930.00</u>	<u>¥10,258.00</u>	<u>¥9,357.00</u>
S1 JPY H	<u>¥14,709.00</u>	<u>¥10,340.00</u>	<u>¥9,609.00</u>
S1 SGD H	<u>SGD184.08</u>	<u>SGD129.14</u>	<u>SGD119.41</u>
W	<u>\$32.89</u>	<u>\$23.21</u>	<u>\$21.00</u>
W CHF H	<u>CHF28.64</u>	<u>CHF20.71</u>	<u>CHF19.36</u>
W EUR H	<u>€29.27</u>	<u>€20.92</u>	<u>€19.53</u>
W GBP H	<u>£29.82</u>	<u>£21.28</u>	<u>£20.01</u>
W SGD H	<u>SGD31.55</u>	<u>SGD22.33</u>	<u>SGD20.55</u>
A — EUR *	<u>€41.90</u>	<u>€32.58</u>	<u>€29.76</u>
I — EUR *	<u>€45.22</u>	<u>€34.88</u>	<u>€31.61</u>
S1 — EUR *	<u>€47.06</u>	<u>€36.16</u>	<u>€32.64</u>
W — EUR *	<u>€26.98</u>	<u>€20.91</u>	<u>€18.81</u>

	Global Plus Fixed Income Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.	<u>\$1,010,390,273</u>	<u>\$1,057,002,284</u>	<u>\$1,016,404,309</u>
Klasse			
1	<u>\$28.09</u>	<u>\$27.57</u>	<u>\$26.37</u>
1 EUR H	<u>€24.26</u>	<u>€24.05</u>	<u>€23.60</u>
1 GBP H	<u>£27.18</u>	<u>£26.78</u>	<u>£26.15</u>
1D	<u>\$20.29</u>	<u>\$20.17</u>	<u>\$19.61</u>
1D EUR H	<u>€19.58</u>	<u>€19.50</u>	<u>€19.14</u>
1D GBP H	<u>£20.18</u>	<u>£20.13</u>	<u>£19.74</u>
2	<u>\$28.26</u>	<u>\$27.72</u>	<u>\$26.50</u>
2 EUR H	<u>€24.37</u>	<u>€24.14</u>	<u>€23.68</u>
2 GBP H	<u>£27.28</u>	<u>£26.86</u>	<u>£26.21</u>
A2	<u>\$19.51</u>	<u>\$19.23</u>	<u>\$18.48</u>
A2 EUR H	<u>€17.28</u>	<u>€17.21</u>	<u>€16.97</u>
A2 SGD H	<u>SGD17.16</u>	<u>SGD16.94</u>	<u>SGD16.40</u>
AR EUR H	<u>€14.71</u>	<u>€14.84</u>	<u>€14.89</u>
AT	<u>\$17.41</u>	<u>\$17.31</u>	<u>\$16.83</u>
AT AUD H	<u>AUD16.74</u>	<u>AUD16.70</u>	<u>AUD16.44</u>
AT CAD H	<u>CAD16.74</u>	<u>CAD16.68</u>	<u>CAD16.29</u>
AT EUR H	<u>€16.52</u>	<u>€16.48</u>	<u>€16.26</u>
AT GBP H	<u>£16.58</u>	<u>£16.54</u>	<u>£16.25</u>
AT SGD H	<u>SGD16.78</u>	<u>SGD16.70</u>	<u>SGD16.27</u>
BT (16)	<u>N/A</u>	<u>\$17.18</u>	<u>\$16.70</u>
BT CAD H (17)	<u>N/A</u>	<u>CAD16.34</u>	<u>CAD16.02</u>
C2	<u>\$18.74</u>	<u>\$18.55</u>	<u>\$17.91</u>
C2 EUR H	<u>€16.65</u>	<u>€16.66</u>	<u>€16.50</u>
CT	<u>\$16.56</u>	<u>\$16.50</u>	<u>\$16.04</u>
I2	<u>\$20.54</u>	<u>\$20.14</u>	<u>\$19.24</u>
I2 EUR H	<u>€18.27</u>	<u>€18.10</u>	<u>€17.73</u>
I2 GBP H	<u>£19.42</u>	<u>£19.11</u>	<u>£18.65</u>
IK EUR H (18)	<u>N/A</u>	<u>€15.69</u>	<u>€15.42</u>
S	<u>\$20.76</u>	<u>\$20.21</u>	<u>\$19.18</u>
S CAD H	<u>CAD114.62</u>	<u>CAD111.91</u>	<u>CAD107.21</u>
S GBP H	<u>£29.97</u>	<u>£29.27</u>	<u>£28.35</u>
S1	<u>\$19.90</u>	<u>\$19.47</u>	<u>\$18.57</u>
S1 EUR H	<u>€25.19</u>	<u>€24.89</u>	<u>€24.37</u>
S1 NOK H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>kr1,776.77</u>
SA	<u>\$106.43</u>	<u>\$105.93</u>	<u>\$103.05</u>

Select Absolute Alpha Portfolio			
	31. Mai 2021^	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$905,115,737</u>	<u>\$766,531,109</u>	<u>\$1,015,700,432</u>
Klasse			
A	<u>\$25.13</u>	<u>\$21.04</u>	<u>\$20.11</u>
A AUD H	<u>AUD22.13</u>	<u>AUD18.59</u>	<u>AUD18.19</u>
A CHF H	<u>CHF18.86</u>	<u>CHF16.00</u>	<u>CHF15.70</u>
A EUR H	<u>€22.98</u>	<u>€19.38</u>	<u>€18.99</u>
A GBP H	<u>£23.79</u>	<u>£20.06</u>	<u>£19.60</u>
A PLN H	<u>PLN121.56</u>	<u>PLN101.82</u>	<u>PLN97.92</u>
A SGD H	<u>SGD25.09</u>	<u>SGD21.06</u>	<u>SGD20.26</u>
C	<u>\$22.62</u>	<u>\$19.01</u>	<u>\$18.23</u>
F	<u>\$30.67</u>	<u>\$24.83</u>	<u>\$23.28</u>
F EUR H	<u>€27.57</u>	<u>€22.50</u>	<u>€21.62</u>
I	<u>\$26.92</u>	<u>\$22.39</u>	<u>\$21.32</u>
I CHF H	<u>CHF19.98</u>	<u>CHF16.82</u>	<u>CHF16.42</u>
I EUR H	<u>€24.47</u>	<u>€20.45</u>	<u>€19.96</u>
I GBP H	<u>£24.93</u>	<u>£20.89</u>	<u>£20.26</u>
N	<u>\$21.55</u>	<u>\$18.10</u>	<u>\$17.35</u>
S	<u>\$34.90</u>	<u>\$27.47</u>	<u>\$25.47</u>
S EUR H	<u>€31.16</u>	<u>€24.72</u>	<u>€23.51</u>
S GBP H	<u>£32.50</u>	<u>£25.76</u>	<u>£24.48</u>
S1	<u>\$29.07</u>	<u>\$23.11</u>	<u>\$21.64</u>
S1 EUR H	<u>€24.78</u>	<u>€20.71</u>	<u>€20.07</u>
S1 GBP H	<u>£25.82</u>	<u>£21.60</u>	<u>£20.93</u>
S1 JPY H	<u>¥14,634.00</u>	<u>¥12,233.00</u>	<u>¥11,794.00</u>
S13 EUR H	<u>€120.59</u>	<u>€99.79</u>	<u>N/A</u>
W	<u>\$19.35</u>	<u>\$16.08</u>	<u>\$15.23</u>
W CHF H	<u>CHF17.85</u>	<u>CHF15.02</u>	<u>CHF14.62</u>
A — EUR *	<u>€20.61</u>	<u>€18.95</u>	<u>€18.01</u>
I — EUR *	<u>€22.08</u>	<u>€20.17</u>	<u>€19.09</u>
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$258,343,961</u>	<u>\$269,329,486</u>	<u>\$259,958,778</u>
Klasse			
A2	<u>\$14.50</u>	<u>\$13.64</u>	<u>\$13.33</u>
A2 CZK H	<u>CZK896.34</u>	<u>CZK854.29</u>	<u>CZK854.26</u>
A2 EUR H	<u>€12.47</u>	<u>€11.90</u>	<u>€11.96</u>
A2 PLN H	<u>PLN103.45</u>	<u>PLN98.44</u>	<u>PLN98.02</u>
AA	<u>\$13.56</u>	<u>\$13.89</u>	<u>\$14.72</u>
AT	<u>\$14.00</u>	<u>\$14.05</u>	<u>N/A</u>
AT SGD H	<u>SGD11.53</u>	<u>SGD11.60</u>	<u>SGD12.10</u>
I2	<u>\$15.26</u>	<u>\$14.28</u>	<u>\$13.87</u>
I2 EUR H	<u>€13.10</u>	<u>€12.44</u>	<u>€12.44</u>
S	<u>\$16.74</u>	<u>\$15.52</u>	<u>\$14.93</u>
S1	<u>\$15.73</u>	<u>\$14.69</u>	<u>\$14.23</u>
SA	<u>\$89.99</u>	<u>\$90.74</u>	<u>N/A</u>
ZT	<u>\$12.62</u>	<u>\$12.69</u>	<u>\$13.19</u>

Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$54,641,918</u>	<u>\$17,995,833</u>	<u>\$22,249,167</u>
Klasse			
A2	<u>\$19.42</u>	<u>\$17.72</u>	<u>\$17.05</u>
A2 AUD H	<u>AUD20.73</u>	<u>AUD19.04</u>	<u>AUD18.66</u>
A2 EUR H	<u>€17.03</u>	<u>€15.74</u>	<u>€15.57</u>
A2 SGD H	<u>SGD18.76</u>	<u>SGD17.17</u>	<u>SGD16.66</u>
AA	<u>\$13.48</u>	<u>\$13.13</u>	<u>\$13.55</u>
AA AUD H	<u>AUD13.10</u>	<u>AUD12.86</u>	<u>AUD13.42</u>
AA CAD H	<u>CAD13.29</u>	<u>CAD13.01</u>	<u>CAD13.49</u>
AA EUR H	<u>€13.31</u>	<u>€13.03</u>	<u>€13.47</u>
AA GBP H	<u>£13.26</u>	<u>£13.00</u>	<u>£13.48</u>
AA SGD H	<u>SGD13.35</u>	<u>SGD13.05</u>	<u>SGD13.49</u>
AR EUR H	<u>€11.94</u>	<u>€11.70</u>	<u>€12.27</u>
AT	<u>\$12.63</u>	<u>\$12.12</u>	<u>\$12.26</u>
AT AUD H	<u>AUD12.10</u>	<u>AUD11.67</u>	<u>AUD11.95</u>
AT CAD H	<u>CAD12.24</u>	<u>CAD11.78</u>	<u>CAD11.98</u>
AT EUR H	<u>€12.34</u>	<u>€11.88</u>	<u>€12.04</u>
AT GBP H	<u>£12.32</u>	<u>£11.86</u>	<u>£12.07</u>
AT SGD H	<u>SGD12.31</u>	<u>SGD11.84</u>	<u>SGD12.01</u>
B2 (19)	<u>N/A</u>	<u>\$16.27</u>	<u>\$15.82</u>
BT (20)	<u>N/A</u>	<u>\$12.20</u>	<u>\$12.32</u>
BT AUD H	<u>AUD12.19</u>	<u>AUD11.74</u>	<u>AUD11.98</u>
BT CAD H (21)	<u>N/A</u>	<u>CAD11.90</u>	<u>CAD12.07</u>
BT EUR H (22)	<u>N/A</u>	<u>€11.97</u>	<u>€12.12</u>
BT GBP H (23)	<u>N/A</u>	<u>£11.98</u>	<u>£12.15</u>
C2	<u>\$18.62</u>	<u>\$17.07</u>	<u>\$16.50</u>
C2 EUR H	<u>€16.30</u>	<u>€15.14</u>	<u>€15.04</u>
I2	<u>\$20.44</u>	<u>\$18.55</u>	<u>\$17.76</u>
I2 EUR H	<u>€17.90</u>	<u>€16.47</u>	<u>€16.18</u>
I2 SGD H	<u>SGD19.78</u>	<u>SGD18.01</u>	<u>SGD17.37</u>
IT	<u>\$12.55</u>	<u>\$12.05</u>	<u>\$12.20</u>
IT AUD H	<u>AUD12.71</u>	<u>AUD12.28</u>	<u>AUD12.58</u>
IT EUR H	<u>€12.23</u>	<u>€11.81</u>	<u>€11.98</u>
IT SGD H	<u>SGD12.90</u>	<u>SGD12.41</u>	<u>SGD12.60</u>
S	<u>\$22.23</u>	<u>\$20.00</u>	<u>\$18.97</u>
S1	<u>\$20.91</u>	<u>\$18.94</u>	<u>\$18.08</u>

Emerging Market Corporate Debt Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$139,319,425</u>	<u>\$101,778,651</u>	<u>\$107,760,119</u>
Klasse			
A2	<u>\$23.34</u>	<u>\$20.08</u>	<u>\$20.20</u>
A2 AUD H	<u>AUD22.58</u>	<u>AUD19.60</u>	<u>AUD20.38</u>
A2 CAD H	<u>CAD21.24</u>	<u>CAD18.39</u>	<u>CAD18.82</u>
A2 EUR H	<u>€20.60</u>	<u>€17.98</u>	<u>€18.59</u>
A2 GBP H	<u>£20.23</u>	<u>£17.55</u>	<u>£18.17</u>
A2 SGD H	<u>SGD21.16</u>	<u>SGD18.26</u>	<u>SGD18.58</u>
AA	<u>\$13.30</u>	<u>\$12.16</u>	<u>\$13.08</u>
AA AUD H	<u>AUD12.62</u>	<u>AUD11.65</u>	<u>AUD12.86</u>
AA SGD H	<u>SGD13.35</u>	<u>SGD12.25</u>	<u>SGD13.25</u>
AR EUR	<u>€12.42</u>	<u>€12.50</u>	<u>€13.38</u>
AT	<u>\$14.26</u>	<u>\$12.83</u>	<u>\$13.54</u>
AT AUD H	<u>AUD14.01</u>	<u>AUD12.73</u>	<u>AUD13.77</u>
AT CAD H	<u>CAD14.30</u>	<u>CAD12.95</u>	<u>CAD13.81</u>
AT EUR H	<u>€14.52</u>	<u>€13.16</u>	<u>€13.92</u>
AT GBP H	<u>£14.27</u>	<u>£12.95</u>	<u>£13.87</u>
AT NZD H	<u>NZD14.22</u>	<u>NZD12.89</u>	<u>NZD13.87</u>
AT RMB H	<u>CNH14.37</u>	<u>CNH12.93</u>	<u>CNH13.68</u>
AT SGD H	<u>SGD14.48</u>	<u>SGD13.07</u>	<u>SGD13.86</u>
C2	<u>\$20.11</u>	<u>\$17.38</u>	<u>\$17.56</u>
CT	<u>\$14.28</u>	<u>\$12.85</u>	<u>\$13.55</u>
I2	<u>\$24.56</u>	<u>\$21.02</u>	<u>\$21.02</u>
I2 EUR H	<u>€21.63</u>	<u>€18.78</u>	<u>€19.30</u>
IT	<u>\$14.26</u>	<u>\$12.83</u>	<u>\$13.53</u>
N2	<u>\$19.95</u>	<u>\$17.27</u>	<u>\$17.46</u>
NT	<u>\$14.33</u>	<u>\$12.91</u>	<u>\$13.61</u>
S	<u>\$27.04</u>	<u>\$22.91</u>	<u>\$22.68</u>
S1	<u>\$25.34</u>	<u>\$21.63</u>	<u>\$21.56</u>
ZT (24)	<u>\$15.03</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
US High Yield Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$159,229,919</u>	<u>\$118,576,458</u>	<u>\$55,877,007</u>
Klasse			
A2	<u>\$24.62</u>	<u>\$20.95</u>	<u>\$20.70</u>
A2 EUR H	<u>€21.67</u>	<u>€18.69</u>	<u>€19.05</u>
A2 SEK H (25)	<u>kr109.79</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
AT	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>\$15.62</u>
C2	<u>\$18.88</u>	<u>\$16.13</u>	<u>\$16.01</u>
I2	<u>\$25.89</u>	<u>\$21.90</u>	<u>\$21.53</u>
I2 EUR H	<u>€22.82</u>	<u>€19.57</u>	<u>€19.84</u>
I2 SEK H (25)	<u>kr110.19</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
IT (26)	<u>\$14.94</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
N2	<u>\$18.43</u>	<u>\$15.76</u>	<u>\$15.66</u>
NT	<u>\$15.32</u>	<u>\$13.71</u>	<u>\$14.20</u>
S1	<u>\$26.70</u>	<u>\$22.52</u>	<u>\$22.05</u>
S1 EUR H	<u>€112.54</u>	<u>€96.20</u>	<u>N/A</u>
ZT	<u>\$15.29</u>	<u>\$13.67</u>	<u>\$14.18</u>

	Low Volatility Equity Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$3,504,385,864</u>	<u>\$3,828,265,565</u>	<u>\$2,582,697,058</u>
Klasse			
A	<u>\$35.36</u>	<u>\$28.41</u>	<u>\$27.73</u>
A AUD H	<u>AUD30.16</u>	<u>AUD24.43</u>	<u>AUD24.81</u>
A EUR	<u>€17.28</u>	<u>€15.24</u>	<u>N/A</u>
A EUR H	<u>€31.46</u>	<u>€25.54</u>	<u>€25.59</u>
A NZD H	<u>NZD31.29</u>	<u>NZD25.28</u>	<u>NZD25.57</u>
A PLN H	<u>PLN121.97</u>	<u>PLN99.08</u>	<u>PLN98.93</u>
A SGD H	<u>SGD29.18</u>	<u>SGD23.50</u>	<u>SGD23.26</u>
AD	<u>\$22.56</u>	<u>\$19.00</u>	<u>\$19.44</u>
AD AUD H	<u>AUD21.21</u>	<u>AUD18.02</u>	<u>AUD19.05</u>
AD CAD H	<u>CAD20.48</u>	<u>CAD17.33</u>	<u>CAD18.12</u>
AD EUR H	<u>€21.09</u>	<u>€17.82</u>	<u>€18.29</u>
AD GBP H	<u>£20.46</u>	<u>£17.36</u>	<u>£18.10</u>
AD NZD H	<u>NZD21.59</u>	<u>NZD18.29</u>	<u>NZD19.28</u>
AD RMB H	<u>CNH113.50</u>	<u>CNH95.53</u>	<u>CNH98.11</u>
AD SGD H	<u>SGD21.97</u>	<u>SGD18.54</u>	<u>SGD19.13</u>
AD ZAR H	<u>R111.18</u>	<u>R93.38</u>	<u>N/A</u>
AR	<u>\$18.29</u>	<u>\$15.70</u>	<u>\$16.33</u>
AR EUR H	<u>€17.93</u>	<u>€15.40</u>	<u>€16.30</u>
C	<u>\$24.15</u>	<u>\$19.49</u>	<u>\$19.11</u>
ED	<u>\$18.34</u>	<u>\$15.45</u>	<u>\$15.80</u>
ED AUD H	<u>AUD16.25</u>	<u>AUD13.81</u>	<u>N/A</u>
ED ZAR H	<u>R107.39</u>	<u>R90.16</u>	<u>N/A</u>
I	<u>\$37.84</u>	<u>\$30.16</u>	<u>\$29.20</u>
I EUR	<u>€17.56</u>	<u>€15.37</u>	<u>N/A</u>
I EUR H	<u>€33.55</u>	<u>€27.03</u>	<u>€26.87</u>
I GBP	<u>£16.98</u>	<u>£15.56</u>	<u>N/A</u>
I GBP H	<u>£22.81</u>	<u>£18.30</u>	<u>£18.30</u>
I SGD H	<u>SGD29.11</u>	<u>SGD23.26</u>	<u>SGD22.83</u>
ID (27)	<u>\$16.84</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
N	<u>\$24.21</u>	<u>\$19.54</u>	<u>\$19.16</u>
S	<u>\$40.74</u>	<u>\$32.21</u>	<u>\$30.92</u>
S EUR H	<u>€36.23</u>	<u>€28.95</u>	<u>€28.53</u>
S1	<u>\$39.09</u>	<u>\$31.06</u>	<u>\$29.97</u>
S1 EUR	<u>€117.89</u>	<u>€102.87</u>	<u>N/A</u>
S1 EUR H	<u>€34.69</u>	<u>€27.85</u>	<u>€27.58</u>
S1D	<u>\$110.56</u>	<u>\$93.12</u>	<u>N/A</u>
SD	<u>\$112.58</u>	<u>\$94.81</u>	<u>\$96.95</u>

Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.	<u>\$984,238,278</u>	<u>\$1,300,455,023</u>	<u>\$1,551,367,386</u>
Klasse			
A	<u>\$24.05</u>	<u>\$17.13</u>	<u>\$17.78</u>
AD	<u>\$14.90</u>	<u>\$10.95</u>	<u>\$11.86</u>
AD AUD H	<u>AUD14.11</u>	<u>AUD10.52</u>	<u>AUD11.76</u>
AD CAD H	<u>CAD14.45</u>	<u>CAD10.71</u>	<u>CAD11.81</u>
AD EUR H	<u>€14.64</u>	<u>€10.86</u>	<u>€11.80</u>
AD GBP H	<u>£14.52</u>	<u>£10.76</u>	<u>£11.81</u>
AD NZD H	<u>NZD14.32</u>	<u>NZD10.63</u>	<u>NZD11.78</u>
AD SGD H	<u>SGD14.71</u>	<u>SGD10.85</u>	<u>SGD11.84</u>
F	<u>\$125.18</u>	<u>\$87.96</u>	<u>\$89.97</u>
F EUR H	<u>€114.42</u>	<u>€81.73</u>	<u>€85.83</u>
I	<u>\$25.48</u>	<u>\$18.00</u>	<u>\$18.53</u>
I GBP H	<u>£17.18</u>	<u>£12.24</u>	<u>£12.95</u>
I SGD H	<u>SGD17.89</u>	<u>SGD12.70</u>	<u>SGD13.24</u>
S	<u>\$27.40</u>	<u>\$19.17</u>	<u>\$19.53</u>
S EUR	<u>€119.25</u>	<u>€91.66</u>	<u>N/A</u>
S GBP	<u>£29.50</u>	<u>£23.72</u>	<u>£23.60</u>
S1	<u>\$25.84</u>	<u>\$18.23</u>	<u>\$18.72</u>

Global Dynamic Bond Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.	<u>£798,905,194</u>	<u>£868,319,181</u>	<u>£730,141,891</u>
Klasse			
A2 CHF H	<u>CHF14.70</u>	<u>CHF14.49</u>	<u>CHF14.66</u>
A2 EUR H	<u>€15.14</u>	<u>€14.90</u>	<u>€15.03</u>
A2 SGD H	<u>SGD16.59</u>	<u>SGD16.16</u>	<u>SGD16.02</u>
A2 USD H	<u>\$17.06</u>	<u>\$16.59</u>	<u>\$16.31</u>
AR EUR H	<u>€13.08</u>	<u>€13.06</u>	<u>€13.47</u>
I2	<u>£16.71</u>	<u>£16.24</u>	<u>£16.19</u>
I2 CHF H	<u>CHF15.22</u>	<u>CHF14.94</u>	<u>CHF15.05</u>
I2 EUR H	<u>€15.78</u>	<u>€15.43</u>	<u>€15.48</u>
I2 USD H	<u>\$17.67</u>	<u>\$17.10</u>	<u>\$16.72</u>
S	<u>£23.45</u>	<u>£22.65</u>	<u>£22.39</u>
S EUR H	<u>€16.63</u>	<u>€16.17</u>	<u>€16.10</u>
S USD H	<u>\$18.76</u>	<u>\$18.04</u>	<u>\$17.46</u>
S1	<u>£17.14</u>	<u>£16.63</u>	<u>£16.51</u>
S1 EUR H	<u>€16.18</u>	<u>€15.80</u>	<u>€15.77</u>
S1 SGD H	<u>SGD104.89</u>	<u>SGD101.57</u>	<u>N/A</u>
S1 USD H	<u>\$18.17</u>	<u>\$17.55</u>	<u>\$17.10</u>
S1QD	<u>£100.13</u>	<u>£98.73</u>	<u>£100.17</u>
SQD	<u>£14.58</u>	<u>£14.38</u>	<u>£14.59</u>

Concentrated US Equity Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$1,302,674,084</u>	<u>\$896,786,290</u>	<u>\$786,312,078</u>
Klasse			
A	<u>\$40.96</u>	<u>\$29.71</u>	<u>\$25.80</u>
A AUD H	<u>AUD40.61</u>	<u>AUD29.80</u>	<u>AUD27.17</u>
A EUR	<u>€36.08</u>	<u>€28.76</u>	<u>€24.80</u>
A EUR H	<u>€37.05</u>	<u>€27.28</u>	<u>€24.49</u>
A SGD H	<u>SGD40.23</u>	<u>SGD29.30</u>	<u>SGD25.86</u>
AR EUR	<u>€27.81</u>	<u>€22.88</u>	<u>€20.43</u>
C	<u>\$39.62</u>	<u>\$28.88</u>	<u>\$25.19</u>
I	<u>\$43.51</u>	<u>\$31.30</u>	<u>\$26.96</u>
I AUD H	<u>AUD42.98</u>	<u>AUD31.28</u>	<u>AUD28.34</u>
I CHF H	<u>CHF38.15</u>	<u>CHF27.88</u>	<u>CHF24.90</u>
I EUR H	<u>€39.21</u>	<u>€28.63</u>	<u>€25.52</u>
I GBP	<u>£19.32</u>	<u>£15.97</u>	<u>N/A</u>
I GBP H	<u>£40.17</u>	<u>£29.19</u>	<u>£26.15</u>
I SGD H	<u>SGD42.76</u>	<u>SGD30.88</u>	<u>SGD27.03</u>
N	<u>\$39.62</u>	<u>\$28.88</u>	<u>\$25.19</u>
S	<u>\$46.77</u>	<u>\$33.36</u>	<u>\$28.47</u>
S EUR H	<u>€42.12</u>	<u>€30.50</u>	<u>€26.93</u>
S1	<u>\$44.15</u>	<u>\$31.73</u>	<u>\$27.28</u>
S1 EUR H	<u>€39.79</u>	<u>€29.03</u>	<u>€25.82</u>
S1 GBP H	<u>£34.25</u>	<u>£24.75</u>	<u>£22.14</u>
SD	<u>\$164.06</u>	<u>\$120.70</u>	<u>\$106.62</u>
S — EUR *	<u>€38.36</u>	<u>€30.05</u>	<u>€25.50</u>
S1 — EUR *	<u>€36.21</u>	<u>€28.59</u>	<u>€24.43</u>

Concentrated Global Equity Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$684,180,114</u>	<u>\$620,205,386</u>	<u>\$236,504,073</u>
Klasse			
A	<u>\$37.30</u>	<u>\$27.12</u>	<u>\$24.22</u>
A EUR H	<u>€32.92</u>	<u>€24.32</u>	<u>€22.33</u>
A SGD H	<u>SGD30.67</u>	<u>SGD22.38</u>	<u>SGD20.26</u>
AR EUR	<u>€24.22</u>	<u>€20.20</u>	<u>€18.68</u>
C	<u>\$26.85</u>	<u>\$19.61</u>	<u>\$17.59</u>
I	<u>\$39.64</u>	<u>\$28.56</u>	<u>\$25.30</u>
I CAD H	<u>CAD27.84</u>	<u>CAD20.23</u>	<u>CAD18.32</u>
I CHF H	<u>CHF33.88</u>	<u>CHF24.84</u>	<u>CHF22.70</u>
I EUR	<u>€19.59</u>	<u>€15.50</u>	<u>N/A</u>
I EUR H	<u>€35.01</u>	<u>€25.63</u>	<u>€23.36</u>
I GBP	<u>£19.35</u>	<u>£16.01</u>	<u>N/A</u>
I GBP H	<u>£35.90</u>	<u>£26.12</u>	<u>£23.91</u>
N	<u>\$29.65</u>	<u>\$21.65</u>	<u>\$19.41</u>
S	<u>\$42.95</u>	<u>\$30.67</u>	<u>\$26.88</u>
S EUR H	<u>€37.86</u>	<u>€27.47</u>	<u>€24.76</u>
S GBP	<u>£40.69</u>	<u>£33.39</u>	<u>£28.58</u>
S1	<u>\$40.25</u>	<u>\$28.99</u>	<u>\$25.62</u>
S1 EUR H	<u>€35.50</u>	<u>€25.98</u>	<u>€23.62</u>
S1 — EUR *	<u>€33.02</u>	<u>€26.12</u>	<u>€22.94</u>

	Global Core Equity Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$1,731,180,339</u>	<u>\$1,024,945,202</u>	<u>\$1,738,495,019</u>
Klasse			
A	<u>\$27.60</u>	<u>\$19.95</u>	<u>\$19.12</u>
A AUD H	<u>AUD26.38</u>	<u>AUD19.25</u>	<u>AUD19.46</u>
A EUR H	<u>€24.39</u>	<u>€17.87</u>	<u>€17.54</u>
A SGD H	<u>SGD26.53</u>	<u>SGD19.23</u>	<u>SGD18.74</u>
AR EUR	<u>€21.25</u>	<u>€17.31</u>	<u>€16.89</u>
C	<u>\$26.76</u>	<u>\$19.44</u>	<u>\$18.71</u>
I	<u>\$29.19</u>	<u>\$20.94</u>	<u>\$19.90</u>
I AUD H	<u>AUD27.78</u>	<u>AUD20.12</u>	<u>AUD20.20</u>
I CHF H	<u>CHF25.23</u>	<u>CHF18.36</u>	<u>CHF17.85</u>
I EUR	<u>€18.41</u>	<u>€14.50</u>	<u>N/A</u>
I EUR H	<u>€25.71</u>	<u>€18.68</u>	<u>€18.19</u>
I GBP H	<u>£26.36</u>	<u>£19.08</u>	<u>£18.84</u>
I SGD H	<u>SGD28.05</u>	<u>SGD20.17</u>	<u>SGD19.48</u>
INN EUR (28)	<u>€18.16</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
IX EUR	<u>€385.03</u>	<u>€302.84</u>	<u>€285.14</u>
N	<u>\$26.76</u>	<u>\$19.43</u>	<u>\$18.70</u>
RX EUR	<u>€337.52</u>	<u>€268.69</u>	<u>€256.26</u>
S	<u>\$31.18</u>	<u>\$22.18</u>	<u>\$20.88</u>
S EUR H	<u>€27.56</u>	<u>€19.85</u>	<u>€19.15</u>
S GBP H	<u>£30.43</u>	<u>£21.85</u>	<u>£21.38</u>
S NOK HP	<u>kr1,221.03</u>	<u>kr908.87</u>	<u>N/A</u>
S1	<u>\$29.89</u>	<u>\$21.39</u>	<u>\$20.26</u>
S1 EUR H	<u>€26.24</u>	<u>€19.01</u>	<u>€18.51</u>
S1 NOK HP	<u>kr1,675.80</u>	<u>kr1,254.47</u>	<u>N/A</u>
S1X EUR	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>€24.94</u>
SD	<u>\$127.41</u>	<u>\$95.11</u>	<u>\$94.46</u>
XX EUR	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>€2,035.42</u>
XX GBP	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>£2,037.77</u>

	Global Income Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$105,464,334</u>	<u>\$89,032,358</u>	<u>\$129,417,172</u>
Klasse			
A2	<u>\$17.48</u>	<u>\$16.16</u>	<u>\$15.86</u>
A2 AUD H	<u>AUD16.60</u>	<u>AUD15.45</u>	<u>AUD15.53</u>
A2 CAD H	<u>CAD16.80</u>	<u>CAD15.61</u>	<u>CAD15.54</u>
A2 CHF H	<u>CHF15.58</u>	<u>CHF14.61</u>	<u>CHF14.80</u>
A2 EUR H	<u>€15.86</u>	<u>€14.85</u>	<u>€14.98</u>
A2 GBP H	<u>£16.25</u>	<u>£15.11</u>	<u>£15.20</u>
A2 PLN H	<u>PLN109.43</u>	<u>PLN101.85</u>	<u>PLN101.52</u>
A2 SGD H	<u>SGD16.79</u>	<u>SGD15.56</u>	<u>SGD15.40</u>
AA	<u>\$14.25</u>	<u>\$14.08</u>	<u>\$14.63</u>
AA AUD H	<u>AUD13.89</u>	<u>AUD13.81</u>	<u>AUD14.60</u>
AA CAD H	<u>CAD14.04</u>	<u>CAD13.93</u>	<u>CAD14.60</u>
AA EUR H	<u>€14.11</u>	<u>€14.01</u>	<u>€14.59</u>
AA SGD H	<u>SGD14.15</u>	<u>SGD14.01</u>	<u>SGD14.60</u>
AT	<u>\$14.90</u>	<u>\$14.50</u>	<u>\$14.85</u>
AT AUD H	<u>AUD14.43</u>	<u>AUD14.13</u>	<u>AUD14.72</u>
AT CAD H	<u>CAD14.76</u>	<u>CAD14.42</u>	<u>CAD14.90</u>
AT EUR H	<u>€14.64</u>	<u>€14.30</u>	<u>€14.69</u>
AT GBP H	<u>£14.52</u>	<u>£14.22</u>	<u>£14.72</u>
AT SGD H	<u>SGD14.71</u>	<u>SGD14.33</u>	<u>SGD14.73</u>
I2	<u>\$17.88</u>	<u>\$16.44</u>	<u>\$16.04</u>
I2 AUD H	<u>AUD17.04</u>	<u>AUD15.77</u>	<u>AUD15.77</u>
I2 CAD H	<u>CAD17.13</u>	<u>CAD15.82</u>	<u>CAD15.66</u>
I2 CHF H	<u>CHF15.89</u>	<u>CHF14.82</u>	<u>CHF14.93</u>
I2 EUR H	<u>€16.21</u>	<u>€15.10</u>	<u>€15.15</u>
I2 GBP H	<u>£16.75</u>	<u>£15.50</u>	<u>£15.50</u>
I2 SGD H	<u>SGD17.22</u>	<u>SGD15.87</u>	<u>SGD15.63</u>
IT	<u>\$14.91</u>	<u>\$14.52</u>	<u>\$14.88</u>
IT AUD H	<u>AUD14.57</u>	<u>AUD14.28</u>	<u>AUD14.88</u>
IT CAD H	<u>CAD14.75</u>	<u>CAD14.42</u>	<u>CAD14.90</u>
IT EUR H	<u>€14.78</u>	<u>€14.46</u>	<u>€14.85</u>
IT SGD H	<u>SGD14.83</u>	<u>SGD14.46</u>	<u>SGD14.87</u>
S	<u>\$122.57</u>	<u>\$111.93</u>	<u>\$108.45</u>
S EUR H	<u>€111.03</u>	<u>€102.67</u>	<u>€102.23</u>
S GBP H	<u>£113.96</u>	<u>£104.68</u>	<u>£103.97</u>
S1	<u>\$120.12</u>	<u>\$110.26</u>	<u>\$107.36</u>
S1 EUR H	<u>€109.08</u>	<u>€101.37</u>	<u>€101.45</u>
S1 GBP H	<u>£112.01</u>	<u>£103.39</u>	<u>£103.15</u>

Alternative Risk Premia Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$60,687,085</u>	<u>\$41,021,722</u>	<u>\$115,354,981</u>
Klasse			
F	<u>\$100.95</u>	<u>\$93.86</u>	<u>\$96.38</u>
F EUR H	<u>€93.35</u>	<u>€87.63</u>	<u>€92.26</u>
F GBP H	<u>£96.23</u>	<u>£89.79</u>	<u>£93.93</u>
I	<u>\$14.93</u>	<u>\$13.93</u>	<u>\$14.36</u>
I EUR H	<u>€13.81</u>	<u>€13.01</u>	<u>€13.75</u>
I GBP H	<u>£14.22</u>	<u>£13.32</u>	<u>£13.99</u>
S	<u>\$102.38</u>	<u>\$94.76</u>	<u>\$96.87</u>
S1	<u>\$99.92</u>	<u>\$93.14</u>	<u>\$95.88</u>
S1 EUR H	<u>€92.44</u>	<u>€86.99</u>	<u>€91.85</u>
S1 GBP H	<u>£95.18</u>	<u>£89.06</u>	<u>£93.47</u>
S1QD	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>\$96.57</u>
S1QD EUR H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>€92.48</u>
S3 AUD H	<u>AUD101.38</u>	<u>AUD95.12</u>	<u>N/A</u>
European Equity Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>€667,940,152</u>	<u>€396,731,620</u>	<u>€575,379,615</u>
Klasse			
A	<u>€19.14</u>	<u>€14.30</u>	<u>€15.88</u>
A AUD H	<u>AUD25.44</u>	<u>AUD19.01</u>	<u>AUD21.48</u>
A HKD H	<u>HKD107.84</u>	<u>HKD79.92</u>	<u>N/A</u>
A SGD H	<u>SGD24.51</u>	<u>SGD18.15</u>	<u>SGD19.88</u>
A USD H	<u>\$25.26</u>	<u>\$18.64</u>	<u>\$20.12</u>
AD	<u>€17.41</u>	<u>€13.53</u>	<u>€15.62</u>
AD AUD H	<u>AUD16.74</u>	<u>AUD13.11</u>	<u>AUD15.68</u>
AD SGD H	<u>SGD16.90</u>	<u>SGD13.10</u>	<u>SGD15.23</u>
AD USD H	<u>\$17.41</u>	<u>\$13.47</u>	<u>\$15.47</u>
B	<u>€15.71</u>	<u>€11.85</u>	<u>€13.29</u>
BD	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>€16.13</u>
BD AUD H	<u>AUD16.63</u>	<u>AUD13.04</u>	<u>AUD15.60</u>
BD USD H	<u>\$17.98</u>	<u>\$13.92</u>	<u>\$15.98</u>
C	<u>€17.57</u>	<u>€13.19</u>	<u>€14.71</u>
C USD H	<u>\$22.82</u>	<u>\$16.92</u>	<u>\$18.34</u>
I	<u>€24.20</u>	<u>€17.94</u>	<u>€19.77</u>
I GBP	<u>£16.68</u>	<u>£12.93</u>	<u>N/A</u>
I USD H	<u>\$24.51</u>	<u>\$17.94</u>	<u>\$19.20</u>
S	<u>€28.29</u>	<u>€20.78</u>	<u>€22.68</u>
S1	<u>€123.14</u>	<u>€91.02</u>	<u>€99.91</u>
S1 GBP	<u>£111.81</u>	<u>£86.42</u>	<u>N/A</u>
S1NN (29)	<u>N/A</u>	<u>€102.06</u>	<u>N/A</u>
S1X	<u>€25.93</u>	<u>€19.16</u>	<u>€21.02</u>
SD	<u>€118.15</u>	<u>€92.19</u>	<u>€106.57</u>
A — USD *	<u>\$23.33</u>	<u>\$15.87</u>	<u>\$17.73</u>
B — USD *	<u>\$19.15</u>	<u>\$13.15</u>	<u>\$14.84</u>
C — USD *	<u>\$21.42</u>	<u>\$14.64</u>	<u>\$16.43</u>
I — USD *	<u>\$29.50</u>	<u>\$19.91</u>	<u>\$22.07</u>
S — USD *	<u>\$34.49</u>	<u>\$23.07</u>	<u>\$25.32</u>
S1 — USD *	<u>\$150.12</u>	<u>\$101.03</u>	<u>\$111.56</u>
S1X — USD *	<u>\$31.61</u>	<u>\$21.27</u>	<u>\$23.47</u>

	Eurozone Equity Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>€854,165,693</u>	<u>€1,227,132,295</u>	<u>€1,203,582,501</u>
Klasse			
A	<u>€30.92</u>	<u>€22.50</u>	<u>€25.58</u>
A AUD H	<u>AUD26.26</u>	<u>AUD19.13</u>	<u>AUD22.31</u>
A PLN H	<u>PLN115.58</u>	<u>PLN84.27</u>	<u>PLN95.31</u>
A SGD H	<u>SGD26.28</u>	<u>SGD18.95</u>	<u>SGD21.31</u>
A USD H	<u>\$27.15</u>	<u>\$19.50</u>	<u>\$21.58</u>
AR	<u>€15.38</u>	<u>€11.37</u>	<u>€13.24</u>
AX	<u>€15.93</u>	<u>€11.59</u>	<u>€13.17</u>
BX	<u>€12.78</u>	<u>€9.39</u>	<u>€10.78</u>
C	<u>€29.45</u>	<u>€21.54</u>	<u>€24.59</u>
C USD H	<u>\$24.82</u>	<u>\$17.90</u>	<u>\$19.91</u>
CX	<u>€11.46</u>	<u>€8.38</u>	<u>€9.56</u>
I	<u>€33.68</u>	<u>€24.32</u>	<u>€27.43</u>
I GBP	<u>£16.99</u>	<u>£12.84</u>	<u>N/A</u>
I USD H	<u>\$26.67</u>	<u>\$19.00</u>	<u>\$20.87</u>
INN	<u>€17.14</u>	<u>€12.56</u>	<u>€14.27</u>
IX	<u>€19.02</u>	<u>€13.73</u>	<u>€15.48</u>
S	<u>€158.97</u>	<u>€113.73</u>	<u>€127.02</u>
S1	<u>€34.78</u>	<u>€25.05</u>	<u>€28.15</u>
S1 GBP	<u>£111.72</u>	<u>£84.15</u>	<u>N/A</u>
S1 USD H	<u>\$30.05</u>	<u>\$21.28</u>	<u>\$23.29</u>
S1N	<u>€119.87</u>	<u>€87.80</u>	<u>€99.54</u>
S1N USD	<u>\$131.26</u>	<u>\$87.52</u>	<u>\$99.63</u>
A — USD *	<u>\$37.70</u>	<u>\$24.98</u>	<u>\$28.56</u>
AX — USD *	<u>\$19.42</u>	<u>\$12.87</u>	<u>\$14.71</u>
BX — USD *	<u>\$15.58</u>	<u>\$10.42</u>	<u>\$12.04</u>
C — USD *	<u>\$35.90</u>	<u>\$23.91</u>	<u>\$27.46</u>
CX — USD *	<u>\$13.97</u>	<u>\$9.30</u>	<u>\$10.67</u>
I — USD *	<u>\$41.06</u>	<u>\$27.00</u>	<u>\$30.63</u>
IX — USD *	<u>\$23.19</u>	<u>\$15.24</u>	<u>\$17.28</u>
S — USD *	<u>\$193.80</u>	<u>\$126.24</u>	<u>\$141.83</u>
S1 — USD *	<u>\$42.40</u>	<u>\$27.81</u>	<u>\$31.43</u>

	American Growth Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.	<u>\$6,384,534,691</u>	<u>\$4,832,171,569</u>	<u>\$3,029,781,934</u>
Klasse			
A	<u>\$163.03</u>	<u>\$123.09</u>	<u>\$95.59</u>
A EUR H	<u>€78.98</u>	<u>€60.53</u>	<u>€48.29</u>
A PLN H	<u>PLN157.53</u>	<u>PLN120.63</u>	<u>PLN95.30</u>
A SGD H	<u>SGD20.39</u>	<u>SGD15.46</u>	<u>N/A</u>
AD	<u>\$40.42</u>	<u>\$31.05</u>	<u>\$24.56</u>
AD AUD H	<u>AUD38.29</u>	<u>AUD29.69</u>	<u>AUD24.21</u>
AD RMB H	<u>CNH153.66</u>	<u>CNH117.91</u>	<u>CNH93.66</u>
AD ZAR H	<u>R264.67</u>	<u>R203.35</u>	<u>R163.05</u>
AX	<u>\$188.01</u>	<u>\$141.13</u>	<u>\$108.97</u>
B	<u>\$122.29</u>	<u>\$93.26</u>	<u>\$73.15</u>
B EUR H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>€44.26</u>
BD	<u>\$40.16</u>	<u>\$30.89</u>	<u>\$24.45</u>
BD AUD H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>AUD23.90</u>
BD ZAR H	<u>R260.51</u>	<u>R200.32</u>	<u>R160.84</u>
BX	<u>\$161.70</u>	<u>\$121.36</u>	<u>\$93.70</u>
C	<u>\$140.13</u>	<u>\$106.28</u>	<u>\$82.91</u>
C EUR H	<u>€75.62</u>	<u>€58.22</u>	<u>€46.66</u>
ED	<u>\$26.15</u>	<u>\$20.11</u>	<u>\$15.92</u>
I	<u>\$197.95</u>	<u>\$148.26</u>	<u>\$114.22</u>
I EUR H	<u>€86.47</u>	<u>€65.74</u>	<u>€52.03</u>
I GBP	<u>£20.43</u>	<u>£17.58</u>	<u>N/A</u>
I GBP H	<u>£23.52</u>	<u>£17.76</u>	<u>N/A</u>
N	<u>\$40.44</u>	<u>\$30.67</u>	<u>\$23.93</u>
S	<u>\$153.92</u>	<u>\$114.27</u>	<u>N/A</u>
S EUR H (30)	<u>N/A</u>	<u>€27.45</u>	<u>€21.53</u>
S1	<u>\$210.35</u>	<u>\$157.18</u>	<u>\$120.76</u>
S1 EUR H	<u>€164.32</u>	<u>€124.64</u>	<u>€98.41</u>
SD	<u>\$288.91</u>	<u>\$221.40</u>	<u>\$174.87</u>
SK	<u>\$172.91</u>	<u>\$129.27</u>	<u>\$99.37</u>
A — EUR *	<u>€133.73</u>	<u>€110.89</u>	<u>€85.61</u>
B — EUR *	<u>€100.31</u>	<u>€84.02</u>	<u>€65.51</u>
C — EUR *	<u>€114.94</u>	<u>€95.75</u>	<u>€74.25</u>
I — EUR *	<u>€162.37</u>	<u>€133.57</u>	<u>€102.29</u>
S — EUR *	<u>€126.26</u>	<u>€102.94</u>	<u>N/A</u>
S1 — EUR *	<u>€172.54</u>	<u>€141.60</u>	<u>€108.15</u>

	All Market Income Portfolio		
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$1,325,580,896</u>	<u>\$1,256,287,188</u>	<u>\$291,505,250</u>
Klasse			
A	<u>\$18.79</u>	<u>\$16.05</u>	<u>\$17.33</u>
A CHF H	<u>CHF16.21</u>	<u>CHF14.04</u>	<u>CHF15.65</u>
A EUR H	<u>€16.71</u>	<u>€14.44</u>	<u>€16.07</u>
A HKD	<u>HKD125.67</u>	<u>HKD107.21</u>	<u>HKD117.11</u>
A SGD H	<u>SGD18.24</u>	<u>SGD15.61</u>	<u>SGD17.05</u>
A2X	<u>\$24.48</u>	<u>\$20.84</u>	<u>\$22.42</u>
AD	<u>\$11.33</u>	<u>\$10.55</u>	<u>\$12.38</u>
AD AUD H	<u>AUD10.76</u>	<u>AUD10.11</u>	<u>AUD12.18</u>
AD CAD H	<u>CAD10.89</u>	<u>CAD10.19</u>	<u>CAD12.13</u>
AD EUR H	<u>€11.07</u>	<u>€10.35</u>	<u>€12.22</u>
AD GBP H	<u>£10.91</u>	<u>£10.22</u>	<u>£12.18</u>
AD HKD	<u>HKD75.64</u>	<u>HKD70.33</u>	<u>HKD83.54</u>
AD NZD H	<u>NZD10.89</u>	<u>NZD10.20</u>	<u>NZD12.22</u>
AD RMB H	<u>CNH99.33</u>	<u>CNH92.41</u>	<u>N/A</u>
AD SGD H	<u>SGD11.07</u>	<u>SGD10.32</u>	<u>SGD12.19</u>
AD ZAR H	<u>R73.15</u>	<u>R68.13</u>	<u>R81.27</u>
AMG	<u>\$14.54</u>	<u>\$13.00</u>	<u>\$14.73</u>
AMG EUR H	<u>€13.63</u>	<u>€12.35</u>	<u>€14.43</u>
ANN	<u>\$15.41</u>	<u>\$13.45</u>	<u>\$14.96</u>
ANN EUR H	<u>€14.46</u>	<u>€12.77</u>	<u>€14.64</u>
AQG	<u>\$14.43</u>	<u>\$12.99</u>	<u>\$14.72</u>
AQG EUR H	<u>€13.54</u>	<u>€12.34</u>	<u>€14.42</u>
AR EUR H	<u>€9.39</u>	<u>€8.97</u>	<u>€10.97</u>
AX	<u>\$16.75</u>	<u>\$14.63</u>	<u>\$16.14</u>
B	<u>\$17.57</u>	<u>\$15.16</u>	<u>\$16.54</u>
B2X	<u>\$20.75</u>	<u>\$17.84</u>	<u>\$19.40</u>
BX	<u>\$16.71</u>	<u>\$14.55</u>	<u>\$16.05</u>
C	<u>\$18.09</u>	<u>\$15.52</u>	<u>\$16.84</u>
C2X	<u>\$22.75</u>	<u>\$19.45</u>	<u>\$21.03</u>
CD	<u>\$11.30</u>	<u>\$10.52</u>	<u>\$12.34</u>
CX	<u>\$16.79</u>	<u>\$14.64</u>	<u>\$16.16</u>
ED	<u>\$14.01</u>	<u>\$13.04</u>	<u>\$15.30</u>
ED AUD H	<u>AUD13.20</u>	<u>AUD12.41</u>	<u>AUD14.93</u>
ED ZAR H	<u>R89.39</u>	<u>R83.32</u>	<u>R99.52</u>
I	<u>\$19.78</u>	<u>\$16.76</u>	<u>\$17.96</u>
I CHF H	<u>CHF17.05</u>	<u>CHF14.65</u>	<u>CHF16.21</u>
I EUR H	<u>€17.57</u>	<u>€15.08</u>	<u>€16.64</u>
I SGD H	<u>SGD19.17</u>	<u>SGD16.28</u>	<u>SGD17.64</u>
ID	<u>\$11.30</u>	<u>\$10.52</u>	<u>\$12.35</u>
IMG	<u>\$14.86</u>	<u>\$13.18</u>	<u>\$14.81</u>
IMG EUR H	<u>€13.94</u>	<u>€12.52</u>	<u>€14.50</u>
INN	<u>\$15.41</u>	<u>\$13.36</u>	<u>\$14.96</u>
INN EUR H	<u>€14.46</u>	<u>€12.76</u>	<u>€14.64</u>
INN GBP H	<u>£14.65</u>	<u>£12.85</u>	<u>£14.74</u>
IQG	<u>\$14.75</u>	<u>\$13.17</u>	<u>\$14.80</u>
IQG EUR H	<u>€13.84</u>	<u>€12.51</u>	<u>€14.50</u>
N	<u>\$18.29</u>	<u>\$15.69</u>	<u>\$17.03</u>
ND	<u>\$11.36</u>	<u>\$10.57</u>	<u>\$12.41</u>

All Market Income Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
S1	\$19.31	\$16.33	\$17.46
S1 CHF H	CHF105.52	CHF90.52	CHF99.86
S1 EUR H	€106.16	€90.90	€100.09
S1 GBP H	£107.74	£91.69	£100.74
S1D JPY H	¥9,106.00	¥8,478.00	¥9,944.00
S1QG GBP H	£94.09	£84.38	£97.40
A2X — EUR *	€20.08	€18.77	€20.08
AX — EUR *	€13.74	€13.18	€14.45
B2X — EUR *	€17.02	€16.07	€17.37
BX — EUR *	€13.71	€13.11	€14.37
C2X — EUR *	€18.66	€17.52	€18.83
CX — EUR *	€13.77	€13.19	€14.47

China A Shares Equity Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	CNH1,999,578,505	CNH973,309,526	CNH191,640,693
Klasse			
A	CNH145.53	CNH107.93	CNH100.45
A AUD H	AUD18.54	AUD14.26	N/A
A CAD H	CAD18.89	CAD14.40	N/A
A EUR	€21.63	€15.63	€14.97
A HKD H	HKD137.57	HKD104.37	N/A
A NZD H	NZD18.76	NZD14.39	N/A
A SGD H	SGD18.97	SGD14.47	N/A
A USD	\$23.51	\$15.52	\$14.90
A USD H	\$20.63	\$15.65	N/A
AD HKD	HKD149.89	HKD101.97	N/A
AD HKD H	HKD135.31	HKD104.36	N/A
AD SGD H	SGD20.06	SGD15.56	N/A
AD USD H	\$20.21	\$15.60	N/A
I	CNH150.01	CNH110.34	CNH101.86
I GBP	£21.78	£16.43	£15.29
I USD H	\$20.81	\$15.68	N/A
S	CNH209.30	CNH152.48	CNH139.38
S USD	\$139.57	\$90.50	N/A
S1	CNH1,477.59	CNH1,084.54	CNH998.85
S1 EUR	€132.13	€94.49	N/A
S1 GBP (9)	£99.51	N/A	N/A
SP1 USD	\$274.24	\$177.82	N/A

Financial Credit Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$205,492,892</u>	<u>\$202,519,837</u>	<u>\$120,336,852</u>
Klasse			
A2	<u>\$19.36</u>	<u>\$16.28</u>	<u>\$15.47</u>
A2 CHF H	<u>CHF17.85</u>	<u>CHF15.19</u>	<u>CHF14.94</u>
A2 EUR H	<u>€17.91</u>	<u>€15.21</u>	<u>€14.98</u>
AT	<u>\$17.43</u>	<u>\$15.21</u>	<u>\$14.97</u>
I2	<u>\$19.70</u>	<u>\$16.46</u>	<u>\$15.56</u>
I2 CHF H	<u>CHF18.15</u>	<u>CHF15.36</u>	<u>CHF15.03</u>
I2 EUR H	<u>€18.18</u>	<u>€15.37</u>	<u>€15.07</u>
I2 GBP H	<u>£18.39</u>	<u>£15.45</u>	<u>£15.23</u>
IT	<u>\$17.47</u>	<u>\$15.24</u>	<u>\$14.97</u>
S	<u>\$134.34</u>	<u>\$111.54</u>	<u>\$104.56</u>
S EUR H	<u>€124.21</u>	<u>€104.19</u>	<u>€101.24</u>
S GBP H	<u>£125.10</u>	<u>£104.51</u>	<u>£102.37</u>
S1	<u>\$132.34</u>	<u>\$110.38</u>	<u>\$104.02</u>
S1 EUR H	<u>€122.35</u>	<u>€103.13</u>	<u>€100.70</u>
S1 GBP H	<u>£123.22</u>	<u>£103.43</u>	<u>£101.82</u>
ZT	<u>\$116.22</u>	<u>\$101.41</u>	<u>\$99.77</u>
Low Volatility Total Return Equity Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen	<u>\$121,966,816</u>	<u>\$154,391,717</u>	<u>\$66,508,276</u>
Klasse			
A	<u>\$14.17</u>	<u>\$15.13</u>	<u>\$15.53</u>
A AUD H	<u>AUD13.48</u>	<u>AUD14.39</u>	<u>N/A</u>
A CAD H	<u>CAD13.51</u>	<u>CAD14.41</u>	<u>N/A</u>
A EUR H	<u>€13.35</u>	<u>€14.36</u>	<u>N/A</u>
A GBP H	<u>£13.46</u>	<u>£14.36</u>	<u>N/A</u>
A HKD	<u>HKD90.04</u>	<u>HKD95.91</u>	<u>N/A</u>
A NZD H	<u>NZD13.54</u>	<u>NZD14.41</u>	<u>N/A</u>
A PLN H	<u>PLN93.90</u>	<u>PLN100.29</u>	<u>N/A</u>
A SGD H	<u>SGD13.51</u>	<u>SGD14.42</u>	<u>N/A</u>
AD	<u>\$12.83</u>	<u>\$14.33</u>	<u>\$15.33</u>
AD AUD H	<u>AUD12.76</u>	<u>AUD14.26</u>	<u>N/A</u>
AD CAD H	<u>CAD12.80</u>	<u>CAD14.28</u>	<u>N/A</u>
AD GBP H	<u>£12.74</u>	<u>£14.23</u>	<u>N/A</u>
AD HKD	<u>HKD85.11</u>	<u>HKD94.90</u>	<u>N/A</u>
AD NZD H	<u>NZD12.81</u>	<u>NZD14.27</u>	<u>N/A</u>
AD SGD H	<u>SGD12.79</u>	<u>SGD14.28</u>	<u>N/A</u>
I	<u>\$14.43</u>	<u>\$15.28</u>	<u>\$15.57</u>
I EUR H (31)	<u>€14.32</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
I PLN H	<u>PLN94.75</u>	<u>PLN100.33</u>	<u>N/A</u>
S	<u>\$98.43</u>	<u>\$103.20</u>	<u>\$104.15</u>
S1	<u>\$97.29</u>	<u>\$102.51</u>	<u>\$103.97</u>
S1 JPY H	<u>¥9,349.00</u>	<u>¥9,906.00</u>	<u>¥10,289.00</u>

Sustainable Global Thematic Credit Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	31. Mai 2019
Nettovermögen.	<u>€29,998,434</u>	<u>€18,615,401</u>	<u>€17,562,433</u>
Klasse			
A2	<u>€15.75</u>	<u>€15.17</u>	<u>N/A</u>
I2	<u>€16.58</u>	<u>€15.91</u>	<u>€15.05</u>
I2 GBP H	<u>£15.94</u>	<u>£15.17</u>	<u>N/A</u>
I2 USD H	<u>\$16.32</u>	<u>\$15.47</u>	<u>N/A</u>
INN AUD H (32)	<u>AUD15.60</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
S	<u>€111.66</u>	<u>€106.57</u>	<u>€100.37</u>
S1	<u>€110.73</u>	<u>€106.11</u>	<u>€100.36</u>
S1 GBP H	<u>£106.33</u>	<u>£101.17</u>	<u>N/A</u>
S1 USD H	<u>\$108.86</u>	<u>\$103.18</u>	<u>N/A</u>
Event Driven Portfolio			
	31. Mai 2021	31. Mai 2020	
Nettovermögen.	<u>\$165,084,607</u>	<u>\$137,548,943</u>	
Klasse			
I (33)	<u>\$15.05</u>	<u>N/A</u>	
S (34)	<u>\$100.95</u>	<u>N/A</u>	
S1	<u>\$103.94</u>	<u>\$98.17</u>	
S1 EUR H	<u>€102.61</u>	<u>€97.76</u>	
SU	<u>\$103.84</u>	<u>\$98.14</u>	
Arya European Alpha Portfolio (35)			
	31. Mai 2021		
Nettovermögen.		<u>€169,983,348</u>	
Klasse			
F (36)		<u>€10.02</u>	
F CHF H (36)		<u>CHF9.92</u>	
F JPY		<u>¥10,507.00</u>	
I (37)		<u>€14.99</u>	
S (36)		<u>€10.35</u>	
S GBP H (36)		<u>£9.88</u>	
SU (36)		<u>€10.05</u>	
Z (36)		<u>€10.31</u>	
Z USD		<u>\$101.85</u>	

* Nur für Informationszwecke.

^ Der NIW und der NIW je Anteil sind der veröffentlichte NIW und der NIW je Anteil einschließlich etwaiger Swing-Anpassungen zum Ende eines Berichtszeitraums.

(1) Auflegungsdatum 21. Mai 2021

(2) Aufgelöst am 20. Mai 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von AUD13.40

(3) Auflegungsdatum 1. Februar 2021

(4) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von CAD28.81

(5) Auflegungsdatum 8. April 2021

(6) Auflegungsdatum 13. April 2021

(7) Auflegungsdatum 19. März 2021

(8) Auflegungsdatum 5. Mai 2021

- (9) Auflegungsdatum 2. Februar 2021
- (10) Auflegungsdatum 23. Februar 2021
- (11) Auflegungsdatum 6. Januar 2021
- (12) Aufgelöst am 10. Mai 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von SGD36.32
- (13) Aufgelöst am 6. November 2020 mit einem endgültigen NIW je Anteil von \$27.18
- (14) Aufgelöst am 9. Dezember 2020 mit einem endgültigen NIW je Anteil von £14.54
- (15) Aufgelöst am 30. September 2020 mit einem endgültigen NIW je Anteil von €97.73
- (16) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von \$17.56
- (17) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von CAD16.67
- (18) Aufgelöst am 25. Juni 2020 mit einem endgültigen NIW je Anteil von €15.81
- (19) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von \$17.89
- (20) Aufgelöst am 31. März 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von \$12.50
- (21) Aufgelöst am 31. März 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von CAD12.15
- (22) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von €12.79
- (23) Aufgelöst am 31. März 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von £12.21
- (24) Auflegungsdatum 26. April 2021
- (25) Auflegungsdatum 2. November 2020
- (26) Auflegungsdatum 10. Februar 2021
- (27) Auflegungsdatum 20. Oktober 2020
- (28) Auflegungsdatum 8. Juni 2020
- (29) Aufgelöst am 23. Dezember 2020 mit einem endgültigen NIW je Anteil von €118.87
- (30) Aufgelöst am 11. Mai 2021 mit einem endgültigen NIW je Anteil von €35.51
- (31) Auflegungsdatum 17. Juli 2020
- (32) Auflegungsdatum 2. Juni 2020
- (33) Auflegungsdatum 12. Mai 2021
- (34) Auflegungsdatum 6. April 2021
- (35) Auflegungsdatum 7. Oktober 2020
- (36) Auflegungsdatum 29. Januar 2021
- (37) Auflegungsdatum 18. Februar 2021

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 einlösbar 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, mit der Absicht, 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.

Das Portefeuille AB SICAV I – Multi-Sector Credit Portfolio wurde vollständig zurückgezahlt. Der Nettoinventarwert („NIW“) wurde zuletzt am 30. Juni 2020 berechnet. Zum 31. Mai 2021 belief sich der Kassenbestand im AB SICAV I – Multi-Sector Credit Portfolio auf \$12,027.

Der Verwaltungsrat beschloss, die Auflegung der folgenden neuen Portefeuilles innerhalb des Fonds zu genehmigen: China Multi-Asset Portfolio, Concentrated European Equity Portfolio, Low Volatility All Market Income Portfolio, Sustainable All Market Portfolio, Arya European Alpha Portfolio und Short Duration Income Portfolio. Diese Portefeuilles nahmen ihre Geschäftstätigkeit am 22. Oktober 2020, 23. September 2020, 9. Oktober 2020, 28. Oktober 2020, 7. Oktober 2020 bzw. 22. Januar 2021 auf.

Der Verwaltungsrat beschloss, die Zusammenlegung aller Vermögenswerte und Verbindlichkeiten des AB Arya ICAV – European Alpha Portfolio, eines dem irischen Recht unterliegenden Organismus zur gemeinsamen Anlage in übertragbare Wertpapiere, mit dem AB SICAV I – Arya European Alpha Portfolio zu genehmigen. Die Zusammenlegung trat zum 28. Januar 2021 in einem Verhältnis von 1:1 in Kraft.

Der Abschluss wurde auf der Grundlage des letzten offiziellen NIW des Jahres erstellt, der gemäß der Definition von Geschäftstagen im Verkaufsprospekt am 31. Mai 2021 für das China A Shares Equity Portfolio und am 28. Mai 2021 für alle anderen Teilfonds mit den Preisen des jeweiligen Tages berechnet wurde.

Die folgende Tabelle zeigt den Beginn der Geschäftstätigkeit der einzelnen Portefeuilles sowie die zum 31. Mai 2021 angebotenen Anteilklassen:

AB SICAV I–	Geschäftsaufnahme	Angebote 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 AUD H, 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, C, I, ID & S1
Sustainable Global Thematic Portfolio	1. September 2006	A, A AUD H, A CAD H, A EUR H, A SGD H, AN, AX, AXX, B, BX, BXX, C, CX, E, E AUD H, I, I AUD, I AUD H, I EUR H, IN, IX, S, S GBP, S1, S1 AUD, S1 AUD H, S1 JPY, 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

AB SICAV I–	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
US Small and Mid-Cap Portfolio	15. März 2010	A, A AUD H, A EUR H, 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
RMB Income Plus Portfolio	23. Mai 2011	A2, AR EUR, AT, C2, CT, I2, IT, S, S1 & W2
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 & 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, C2, C2 EUR H, CT, I2, I2 EUR H, I2 GBP 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, S1, SA & 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, BT AUD 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 & ZT

AB SICAV I–	Geschäftsaufnahme	Angebote Anteilklassen
US High Yield Portfolio	29. März 2012	A2, A2 EUR H, A2 SEK H, C2, I2, I2 EUR H, I2 SEK H, IT, N2, NT, S1, S1 EUR H & ZT
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, ID, 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, INN EUR, 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, 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
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, S1, S1 EUR H, SD & SK

AB SICAV I–	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
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, S1 GBP & 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
Low Volatility Total Return Equity Portfolio	1. Februar 2019	A, A AUD H, A CAD H, A EUR H, A GBP H, A HKD, A NZD H, A PLN H, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD GBP H, AD HKD, AD NZD H, AD SGD H, I, I EUR H, I PLN H, S, S1 & S1 JPY H
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	16. Mai 2019	A2, I2, I2 GBP H, I2 USD H, INN AUD H, S, S1, S1 GBP H & S1 USD H
Event Driven Portfolio	26. Februar 2020	I, S, S1, S1 EUR H & SU
Arya European Alpha Portfolio	7. Oktober 2020	F, F CHF H, F JPY, I, S, S GBP H, SU, Z & Z USD

ANMERKUNG B: Relevante Bilanzierungsgrundsätze

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

1. Bewertung**1.1 Anlagen in Wertpapiere**

An einer Börse notierte oder an einem anderen 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 auf Basis der Marktnotierungen oder, wenn keine Marktnotierungen verfügbar sind oder diese als unzuverlässig gelten, zum „angemessenen Marktwert“ entsprechend den Verfahren bewertet, die vom und unter der allgemeinen Aufsicht des Verwaltungsrats (der „Verwaltungsrat“) und des Vorstands der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.

Angemessene Bewertungsverfahren sollen die Schlusskurse der Wertpapiere des Portefeuilles so berichtigen, dass sie den zum Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles als angemessen erachteten Wert jener Wertpapiere widerspiegeln.

Wenn hinsichtlich eines bestimmten Portefeuille-Wertpapiers Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts eingesetzt werden, können eine Reihe objektiver und subjektiver Faktoren berücksichtigt werden, darunter z. B. Entwicklungen seit der letzten Kursnotierung des Wertpapiers, die sich auf das Wertpapier bzw. auf einen gesamten Markt auswirken, aktuelle Bewertungen entsprechender Aktienindizes oder Äußerungen bestimmter Regierungsbehörden. Soweit verfügbar, können die angemessenen Werte verwendet werden, die von den Bewertungsmodellen dritter Händler ermittelt werden. Wenn Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts eingesetzt werden, können die Kurse einzelner Portefeuille-Wertpapiere, die zur Berechnung des Nettoinventarwerts („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 Verfahren bestimmt, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft und des Verwaltungsrats festgelegt werden.

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 „Änderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ ausgewiesen werden. Bei Fälligkeit oder Verkauf eines Swap-Kontrakts wird der Nettobetrag unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens erfasst. Die bezahlten oder erhaltenen Vorabgebühren werden in der Zusammensetzung des Fondsvermögens als Kosten oder Erlöse ausgewiesen und linear über die Laufzeit des Vertrages abgeschrieben. Abgrenzungen abgeschriebener, bezahlter Vorabgebühren auf Credit-Default-Swaps sind in den „Swap-Erträgen“ enthalten, bis die Position verkauft wird. Danach sind die abgeschriebenen, bezahlten Vorabgebühren unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ enthalten. Bei allen anderen Arten von Swaps werden die abgeschriebenen, bezahlten Vorabgebühren unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ ausgewiesen. Schwankungen des Werts von Swap-Kontrakten werden als eine Komponente der „Änderung der unrealisierten 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 Portefeuilles werden linear zu folgenden Daten abgeschrieben.

AB SICAV I–	Datum
China A Shares Equity Portfolio	Oktober 2020
Low Volatility Total Return Equity Portfolio	Februar 2024
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	Mai 2024
Event Driven Portfolio	Februar 2025
Arya European Alpha Portfolio	Oktober 2025

Die Gründungskosten anderer Portefeuilles wurden in früheren Jahren vollständig abgeschrieben.

3. Zuteilungsmethode

Die Erträge und Aufwendungen (mit Ausnahme der klassenspezifischen Verwaltungs- und Vertriebsgebühren) der „Renten“- und „Misch“-Portefeuilles 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 Portefeuilles umgerechnet.

Die kombinierte Zusammensetzung des Fondsvermögens wird in US-Dollar zu den am Datum der kombinierten Zusammensetzung des Fondsvermögens geltenden Wechselkursen dargestellt, während die kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens in US-Dollar zu den durchschnittlichen, während des Geschäftsjahres geltenden Wechselkursen dargestellt wird. Dem Jahresabschluss wurden folgende Kurse zugrunde gelegt: der Kassakurs von 0.8179 und der Durchschnittskurs von 0.8431 für USD zu EUR, der Kassakurs von 6.3735 und der Durchschnittskurs von 6.6667 für USD zu CNH sowie der Kassakurs von 0.7040 und der Durchschnittskurs von 0.7496 für USD zu GBP.

Die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens ausgewiesene „Währungsberichtigung“ ergibt sich aus der Differenz der Wechselkurse, die für die Umrechnung des konsolidierten Nettovermögens zu Beginn des Geschäftsjahres, der Aufstellung der Vermögenswerte und Verbindlichkeiten und der Ertrags- und Aufwandsrechnung und 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)

Der Verwaltungsrat hat allen Anteilhabern 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 Anteilhaber 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 Anteilhaber-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 Anteilhaber 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 Portefeuille als angemessen erachtet, um sicherzustellen, dass sich die aktuellen Transaktionskosten im Zusammenhang mit der COVID-19-Krise nicht negativ auf die übrigen Anteilhaber des Fonds auswirken.

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 Portefeuilles, die dem Swing Pricing unterliegen, mit Ausnahme des Event Driven Portfolio, passten den NIW während des Berichtszeitraums an. Zum 31. Mai 2021 nahm das folgende Portefeuille eine NIW-Anpassung vor:

- Select Absolute Alpha 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. 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 China („VRC“)

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 Portefeuille 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 andere Wertpapiere in der VRC stammen, der RQFII oder das entsprechende anlegende Portfeuille als Steuerzahler gilt.

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

Falls die betreffenden Portfeuille als Steuerzahler gelten, unterliegen die betreffenden Portfeuille des chinesischen Körperschaftssteuer in Höhe von 25% ihrer weltweiten steuerpflichtigen Einkünfte, falls sie als steuerpflichtige, in der VRC ansässige Unternehmen gelten. Falls das Portfeuille als nicht steuerlich ansässiges Unternehmen behandelt wird, das eine Niederlassung oder einen dauerhaften Sitz 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 Portfeuille so zu verwalten und zu betreiben, dass die Portfeuille und der Fonds für Zwecke der Körperschaftssteuer nicht als steuerpflichtiges, in der VRC ansässiges Unternehmen oder als nicht steuerlich ansässiges Unternehmen mit dauerhaftem Sitz in der VRC behandelt werden, wobei dies jedoch nicht garantiert werden kann. Es wird daher erwartet, dass die Portfeuille lediglich der Quellensteuer von 10% unterliegen, soweit das betreffende Portfeuille 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-Anlage-

quote 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 VRC für von ausländischen institutionellen Anlegern verdiente Anleihezinsen gewährt wird. Gemäß Rundschreiben 108 sind ausländische institutionelle Anleger vorübergehend in der VRC 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 Portfeuille Dividenden auszuschütten: International Technology Portfolio, US Small and Mid-Cap Portfolio, Select Absolute Alpha Portfolio, Event Driven Portfolio und Arya European 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 auf diese Anteile entfallenden Nettoerträge und realisierten Nettogewinne den zur Zahlung festgesetzten Betrag übersteigen, wird die Überschussrendite im jeweiligen NIW dieser Anteile berücksichtigt. 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 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 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 Klassen AD und SD (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 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 Erträge und realisierten Gewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widerspiegelt.

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 widerspiegelt.
- 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 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 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 Erträge und realisierten Gewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widerspiegelt.
- Für Anteile der Klassen AT, CT, IT und ZT 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 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 widerspiegelt.
- Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT und S1T (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 beabsich-

tigt, 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, 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. 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. Dividenden werden automatisch in weiteren Anteilen derselben Klasse wiederangelegt, es sei denn, der Anteilinhaber weist den Verwaltungsrat schriftlich zur Auszahlung in Form von Barmitteln an. Dividenden zur Wiederanlage werden an die Verwaltungsgesellschaft gezahlt, die sie am Dividendenzahlungstag zum Angebotspreis an diesem Tag oder einem anderen von Zeit zu Zeit vereinbarten Preis in den Kauf von Anteilen reinvestiert. 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 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 Anteilklasse 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 Nettoer-

träge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widerspiegelt.

- 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 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 Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A2, 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 widerspiegelt.
- 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 Anteilklasse eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwen-

dungen), 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 widerspiegelt.
- 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 Klassen AA und EA (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 Erträge und realisierten Gewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im Nettoinventarwert der Anteile widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD, ID, 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. 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 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 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 Nettoer-

träge 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 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 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 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 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 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, LT 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 AA und EA (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 Klasse SQD darf der Verwaltungsrat nach eigenem Ermessen Dividenden erklären und ausschütten, die auf den Nettoerträgen des Portefeuilles basieren, die der Anteilklasse zuzuweisen 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 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 den Nettoerträgen des Portefeuilles und, falls diese erschöpft sind, aus den unrealisierten Kapitalgewinnen oder aus dem 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 dieser Anteilklasse 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 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 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, 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 Low Volatility Total Return Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, E, 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 AD und ID (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 Sustainable Global Thematic Credit Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A2, I2, S, S1 und Z2 (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(a)	3.00%
	Klasse C	2.45%
	Klasse I	1.20%
	Klasse ID	1.20%
	Klasse S1	0.75%
Sustainable Global Thematic		
Portfolio	Klasse A	2.25%
	Klasse A AUD H	2.25%
	Klasse A CAD 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 CAD H(b)	3.25%
	Klasse C	2.70%
	Klasse E	3.25%
	Klasse E AUD H	3.25%
	Klasse I	1.45%
	Klasse I AUD	1.45%
	Klasse I AUD H	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 S1 AUD	0.85%
	Klasse S1 AUD H	0.85%
	Klasse S1 JPY	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%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Euro High Yield Portfolio		
(Fortsetzung)	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(c)	2.00%
	Klasse B(d)	3.00%
	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%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%	AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Emerging Markets Multi-Asset			Short Duration High Yield		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AD GBP H	1.95%	Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse AT SGD H	1.45%
	Klasse AD RMB H	1.95%		Klasse B2	2.45%
	Klasse AD SGD H	1.95%		Klasse BT	2.45%
	Klasse AD ZAR H	1.95%		Klasse BT CAD H	2.45%
	Klasse AR	1.95%		Klasse C2	1.90%
	Klasse AR EUR H	1.95%		Klasse CT	1.90%
	Klasse B	2.95%		Klasse I2	0.90%
	Klasse BD	2.95%		Klasse I2 CHF H	0.90%
	Klasse C	2.40%		Klasse I2 EUR H	0.90%
	Klasse ED	2.95%		Klasse I2 GBP H	0.90%
	Klasse ED AUD H	2.95%		Klasse IT	0.90%
	Klasse ED ZAR H	2.95%		Klasse IT EUR H	0.90%
	Klasse I	1.15%		Klasse IT GBP H	0.90%
	Klasse I CHF H	1.15%		Klasse IT SGD H	0.90%
	Klasse I EUR H	1.15%		Klasse N2	2.00%
	Klasse I GBP	1.15%		Klasse NT	2.00%
	Klasse I GBP H	1.15%		Klasse S	0.15%
	Klasse ID	1.15%		Klasse S1	0.65%
	Klasse ID GBP H	1.15%		Klasse S1QD EUR H(f)	0.65%
	Klasse N	2.40%		Klasse W2 CHF H	0.90%
	Klasse S	0.15%	Select US Equity Portfolio . .	Klasse A	2.10%
	Klasse S GBP H	0.15%		Klasse A AUD H	2.10%
	Klasse S1	0.95%		Klasse A CHF H	2.10%
	Klasse S1 JPY	0.95%		Klasse A CZK H	2.10%
	Klasse S1 JPY H	0.95%		Klasse A EUR H	2.10%
	Klasse S1D	0.95%		Klasse A GBP H	2.10%
	Klasse SD	0.15%		Klasse A PLN H	2.10%
	Klasse SQD GBP H(e)	0.15%		Klasse A SGD H	2.10%
RMB Income Plus				Klasse AR	2.10%
Portfolio	Klasse A2	1.50%		Klasse AR EUR H	2.10%
	Klasse AR EUR	1.50%		Klasse C	2.55%
	Klasse AT	1.50%		Klasse F	0.76%
	Klasse C2	1.95%		Klasse F EUR H	0.76%
	Klasse CT	1.95%		Klasse I	1.30%
	Klasse I2	0.95%		Klasse I CHF H	1.30%
	Klasse IT	0.95%		Klasse I EUR H	1.30%
	Klasse S	0.15%		Klasse I GBP H	1.30%
	Klasse S1	0.70%		Klasse I SGD H	1.30%
	Klasse W2	0.95%		Klasse N	2.55%
Short Duration High Yield				Klasse S	0.15%
Portfolio	Klasse A2	1.45%		Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse A2 CHF H	1.45%		Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse A2 EUR H	1.45%		Klasse S1	0.90%
	Klasse A2 GBP H	1.45%		Klasse S1 EUR H	0.90%
	Klasse AA	1.45%		Klasse S1 GBP H	0.90%
	Klasse AA AUD H	1.45%		Klasse S1 JPY	0.90%
	Klasse AA SGD H	1.45%		Klasse S1 JPY H	0.90%
	Klasse AR EUR H	1.45%		Klasse S1 SGD H	0.90%
	Klasse AT	1.45%		Klasse W	0.40%
	Klasse AT AUD H	1.45%		Klasse W CHF H	0.40%
	Klasse AT CAD H	1.45%		Klasse W EUR H	0.40%
	Klasse AT EUR H	1.45%		Klasse W GBP H	0.40%
	Klasse AT GBP H	1.45%		Klasse W SGD H	0.40%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%	AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Global Plus Fixed Income			Select Absolute Alpha		
Portfolio	Klasse 1	0.90%	Portfolio (Fortsetzung) . . .	Klasse S1 EUR H	1.15%
	Klasse 1 EUR H	0.90%		Klasse S1 GBP H	1.15%
	Klasse 1 GBP H	0.90%		Klasse S1 JPY H	1.15%
	Klasse 1D	0.90%		Klasse S13 EUR H	0.99%
	Klasse 1D EUR H	0.90%		Klasse W	1.45%
	Klasse 1D GBP H	0.90%		Klasse W CHF H	1.45%
	Klasse 2	0.90%	Emerging Market Local		
	Klasse 2 EUR H	0.90%	Currency Debt Portfolio . . .	Klasse A2	1.75%
	Klasse 2 GBP H	0.90%		Klasse A2 CZK H	1.75%
	Klasse A2	1.50%		Klasse A2 EUR H	1.75%
	Klasse A2 EUR H	1.50%		Klasse A2 PLN H	1.75%
	Klasse A2 SGD H	1.50%		Klasse AA	1.75%
	Klasse AR EUR H	1.50%		Klasse AT	1.75%
	Klasse AT	1.50%		Klasse AT SGD H	1.75%
	Klasse AT AUD H	1.50%		Klasse I2	1.20%
	Klasse AT CAD H	1.50%		Klasse I2 EUR H	1.20%
	Klasse AT EUR H	1.50%		Klasse S	0.15%
	Klasse AT GBP H	1.50%		Klasse S1	0.85%
	Klasse AT SGD H	1.50%		Klasse SA	0.15%
	Klasse BT(b)	2.50%		Klasse ZT	0.01%
	Klasse BT CAD H(b)	2.50%	Asia Pacific Local Currency		
	Klasse C2	1.95%	Debt Portfolio	Klasse A2	1.60%
	Klasse C2 EUR H	1.95%		Klasse A2 AUD H	1.60%
	Klasse CT	1.95%		Klasse A2 EUR H	1.60%
	Klasse I2	0.95%		Klasse A2 SGD H	1.60%
	Klasse I2 EUR H	0.95%		Klasse AA	1.60%
	Klasse I2 GBP H	0.95%		Klasse AA AUD H	1.60%
	Klasse IK EUR H(g)	0.95%		Klasse AA CAD H	1.60%
	Klasse S	0.15%		Klasse AA EUR H	1.60%
	Klasse S CAD H	0.15%		Klasse AA GBP H	1.60%
	Klasse S GBP H	0.15%		Klasse AA SGD H	1.60%
	Klasse S1	0.65%		Klasse AR EUR H	1.60%
	Klasse S1 EUR H	0.65%		Klasse AT	1.60%
	Klasse SA	0.15%		Klasse AT AUD H	1.60%
Select Absolute Alpha				Klasse AT CAD H	1.60%
Portfolio	Klasse A	2.25%		Klasse AT EUR H	1.60%
	Klasse A AUD H	2.25%		Klasse AT GBP H	1.60%
	Klasse A CHF H	2.25%		Klasse AT SGD H	1.60%
	Klasse A EUR H	2.25%		Klasse B2(b)	2.60%
	Klasse A GBP H	2.25%		Klasse BT(h)	2.60%
	Klasse A PLN H	2.25%		Klasse BT AUD H	2.60%
	Klasse A SGD H	2.25%		Klasse BT CAD H(h)	2.60%
	Klasse C	2.70%		Klasse BT EUR H(b)	2.60%
	Klasse F	0.81%		Klasse BT GBP H(h)	2.60%
	Klasse F EUR H	0.81%		Klasse C2	2.05%
	Klasse I	1.45%		Klasse C2 EUR H	2.05%
	Klasse I CHF H	1.45%		Klasse I2	1.05%
	Klasse I EUR H	1.45%		Klasse I2 EUR H	1.05%
	Klasse I GBP H	1.45%		Klasse I2 SGD H	1.05%
	Klasse N	2.70%		Klasse IT	1.05%
	Klasse S	0.15%		Klasse IT AUD H	1.05%
	Klasse S EUR H	0.15%		Klasse IT EUR H	1.05%
	Klasse S GBP H	0.15%		Klasse IT SGD H	1.05%
	Klasse S1	1.15%			

AB SICAV I–	Anteilklasse	%	AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Asia Pacific Local Currency			Low Volatility Equity		
Debt Portfolio			Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AD AUD H	1.90%
(Fortsetzung)	Klasse S	0.15%		Klasse AD CAD H	1.90%
	Klasse S1	0.80%		Klasse AD EUR H	1.90%
Emerging Market Corporate				Klasse AD GBP H	1.90%
Debt Portfolio	Klasse A2	1.75%		Klasse AD NZD H	1.90%
	Klasse A2 AUD H	1.75%		Klasse AD RMB H	1.90%
	Klasse A2 CAD H	1.75%		Klasse AD SGD H	1.90%
	Klasse A2 EUR H	1.75%		Klasse AD ZAR H	1.90%
	Klasse A2 GBP H	1.75%		Klasse AR	1.90%
	Klasse A2 SGD H	1.75%		Klasse AR EUR H	1.90%
	Klasse AA	1.75%		Klasse C	2.35%
	Klasse AA AUD H	1.75%		Klasse ED	2.90%
	Klasse AA SGD H	1.75%		Klasse ED AUD H	2.90%
	Klasse AR EUR	1.75%		Klasse ED ZAR H	2.90%
	Klasse AT	1.75%		Klasse I	1.10%
	Klasse AT AUD H	1.75%		Klasse I EUR	1.10%
	Klasse AT CAD H	1.75%		Klasse I EUR H	1.10%
	Klasse AT EUR H	1.75%		Klasse I GBP	1.10%
	Klasse AT GBP H	1.75%		Klasse I GBP H	1.10%
	Klasse AT NZD H	1.75%		Klasse I SGD H	1.10%
	Klasse AT RMB H	1.75%		Klasse ID	1.10%
	Klasse AT SGD H	1.75%		Klasse N	2.35%
	Klasse C2	2.20%		Klasse S	0.15%
	Klasse CT	2.20%		Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse I2	1.20%		Klasse S1	0.65%
	Klasse I2 EUR H	1.20%		Klasse S1 EUR	0.65%
	Klasse IT	1.20%		Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse N2	2.30%		Klasse S1D	0.65%
	Klasse NT	2.30%		Klasse SD	0.15%
	Klasse S	0.15%	Emerging Markets Low		
	Klasse S1	0.85%	Volatility Equity		
	Klasse ZT	0.01%	Portfolio	Klasse A	1.95%
US High Yield Portfolio	Klasse A2	1.55%		Klasse AD	1.95%
	Klasse A2 EUR H	1.55%		Klasse AD AUD H	1.95%
	Klasse A2 SEK H	1.55%		Klasse AD CAD H	1.95%
	Klasse C2	2.00%		Klasse AD EUR H	1.95%
	Klasse I2	1.00%		Klasse AD GBP H	1.95%
	Klasse I2 EUR H	1.00%		Klasse AD NZD H	1.95%
	Klasse I2 SEK H	1.00%		Klasse AD SGD H	1.95%
	Klasse IT	1.00%		Klasse F	0.575%
	Klasse N2	2.10%		Klasse F EUR H	0.575%
	Klasse NT	2.10%		Klasse I	1.15%
	Klasse S1	0.65%		Klasse I GBP H	1.15%
	Klasse S1 EUR H	0.65%		Klasse I SGD H	1.15%
	Klasse ZT	0.01%		Klasse S	0.15%
Low Volatility Equity				Klasse S EUR	0.15%
Portfolio	Klasse A	1.90%		Klasse S GBP	0.15%
	Klasse A AUD H	1.90%		Klasse S1	1.00%
	Klasse A EUR	1.90%	Global Dynamic Bond		
	Klasse A EUR H	1.90%	Portfolio	Klasse A2 CHF H	1.25%
	Klasse A NZD H	1.90%		Klasse A2 EUR H	1.25%
	Klasse A PLN H	1.90%		Klasse A2 SGD H	1.25%
	Klasse A SGD H	1.90%		Klasse A2 USD H	1.25%
	Klasse AD	1.90%		Klasse AR EUR H	1.25%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%	AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Global Dynamic Bond			Global Core Equity		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse I2	0.70%	Portfolio (Fortsetzung)	Klasse I CHF H	1.10%
	Klasse I2 CHF H	0.70%		Klasse I EUR	1.10%
	Klasse I2 EUR H	0.70%		Klasse I EUR H	1.10%
	Klasse I2 USD H	0.70%		Klasse I GBP H	1.10%
Concentrated US Equity				Klasse I SGD H	1.10%
Portfolio	Klasse A	1.79%		Klasse INN EUR	1.10%
	Klasse A AUD H	1.79%		Klasse IX EUR	0.80%
	Klasse A EUR	1.79%		Klasse N	2.35%
	Klasse A EUR H	1.79%		Klasse RX EUR	1.99%
	Klasse A SGD H	1.79%		Klasse S	0.15%
	Klasse AR EUR	1.79%		Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse C	2.30%		Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse I	0.94%		Klasse S NOK HP	0.15%
	Klasse I AUD H	0.94%		Klasse S1	0.75%
	Klasse I CHF H	0.94%		Klasse S1 EUR H	0.75%
	Klasse I EUR H	0.94%		Klasse S1 NOK HP	0.75%
	Klasse I GBP	0.94%		Klasse SD	0.15%
	Klasse I GBP H	0.94%	Global Income Portfolio	Klasse A2	1.40%
	Klasse I SGD H	0.94%		Klasse A2 AUD H	1.40%
	Klasse N	2.30%		Klasse A2 CAD H	1.40%
	Klasse S	0.15%		Klasse A2 CHF H	1.40%
	Klasse S EUR H	0.15%		Klasse A2 EUR H	1.40%
	Klasse S1	0.90%		Klasse A2 GBP H	1.40%
	Klasse S1 EUR H	0.90%		Klasse A2 PLN H	1.40%
	Klasse S1 GBP H	0.90%		Klasse A2 SGD H	1.40%
	Klasse SD	0.15%		Klasse AA	1.40%
Concentrated Global Equity				Klasse AA AUD H	1.40%
Portfolio	Klasse A	1.89%		Klasse AA CAD H	1.40%
	Klasse A EUR H	1.89%		Klasse AA EUR H	1.40%
	Klasse A SGD H	1.89%		Klasse AA SGD H	1.40%
	Klasse AR EUR	1.89%		Klasse AT	1.40%
	Klasse C	2.45%		Klasse AT AUD H	1.40%
	Klasse I	0.99%		Klasse AT CAD H	1.40%
	Klasse I CAD H	0.99%		Klasse AT EUR H	1.40%
	Klasse I CHF H	0.99%		Klasse AT GBP H	1.40%
	Klasse I EUR	0.99%		Klasse AT SGD H	1.40%
	Klasse I EUR H	0.99%		Klasse I2	0.85%
	Klasse I GBP	0.99%		Klasse I2 AUD H	0.85%
	Klasse I GBP H	0.99%		Klasse I2 CAD H	0.85%
	Klasse N	2.45%		Klasse I2 CHF H	0.85%
	Klasse S	0.15%		Klasse I2 EUR H	0.85%
	Klasse S EUR H	0.15%		Klasse I2 GBP H	0.85%
	Klasse S GBP	0.15%		Klasse I2 SGD H	0.85%
	Klasse S1	1.00%		Klasse IT	0.85%
	Klasse S1 EUR H	1.00%		Klasse IT AUD H	0.85%
Global Core Equity				Klasse IT CAD H	0.85%
Portfolio	Klasse A	1.90%		Klasse IT EUR H	0.85%
	Klasse A AUD H	1.90%		Klasse IT SGD H	0.85%
	Klasse A EUR H	1.90%		Klasse S	0.15%
	Klasse A SGD H	1.90%		Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse AR EUR	1.90%		Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse C	2.35%		Klasse S1	0.65%
	Klasse I	1.10%		Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse I AUD H	1.10%		Klasse S1 GBP H	0.65%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%	AB SICAV I–	Anteilklasse	%
Alternative Risk Premia			All Market Income		
Portfolio	Klasse F	0.60%	Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AD	1.85%
	Klasse F EUR H	0.60%		Klasse AD AUD H	1.85%
	Klasse F GBP H	0.60%		Klasse AD CAD H	1.85%
	Klasse I	0.95%		Klasse AD EUR H	1.85%
	Klasse I EUR H	0.95%		Klasse AD GBP H	1.85%
	Klasse I GBP H	0.95%		Klasse AD HKD	1.85%
	Klasse S	0.15%		Klasse AD NZD H	1.85%
	Klasse S1	0.85%		Klasse AD RMB H	1.85%
	Klasse S1 EUR H	0.85%		Klasse AD SGD H	1.85%
	Klasse S1 GBP H	0.85%		Klasse AD ZAR H	1.85%
	Klasse S3 AUD H	0.15%		Klasse AMG	1.85%
European Equity Portfolio . . .				Klasse AMG EUR H	1.85%
	Klasse S	0.15%		Klasse ANN	1.85%
	Klasse S1	0.75%		Klasse ANN EUR H	1.85%
	Klasse S1 GBP	0.75%		Klasse AQG	1.85%
	Klasse S1NN(i)	0.75%		Klasse AQG EUR H	1.85%
	Klasse S1X	0.70%		Klasse AR EUR H	1.85%
	Klasse SD	0.15%		Klasse AX	1.65%
Eurozone Equity				Klasse B	2.85%
Portfolio	Klasse A	1.95%		Klasse B2X	2.65%
	Klasse A AUD H	1.95%		Klasse BX	2.65%
	Klasse A PLN H	1.95%		Klasse C	2.30%
	Klasse A SGD H	1.95%		Klasse C2X	2.10%
	Klasse A USD H	1.95%		Klasse CD	2.30%
	Klasse AR	1.95%		Klasse CX	2.10%
	Klasse AX	1.90%		Klasse ED	2.85%
	Klasse BX	2.90%		Klasse ED AUD H	2.85%
	Klasse C	2.40%		Klasse ED ZAR H	2.85%
	Klasse C USD H	2.40%		Klasse I	1.05%
	Klasse CX	2.35%		Klasse I CHF H	1.05%
	Klasse I	1.15%		Klasse I EUR H	1.05%
	Klasse I GBP	1.15%		Klasse I SGD H	1.05%
	Klasse I USD H	1.15%		Klasse ID	1.05%
	Klasse INN	1.15%		Klasse IMG	1.05%
	Klasse IX	1.10%		Klasse IMG EUR H	1.05%
	Klasse S	0.15%		Klasse INN	1.05%
	Klasse S1	0.80%		Klasse INN EUR H	1.05%
	Klasse S1 GBP	0.80%		Klasse INN GBP H	1.05%
	Klasse S1 USD H	0.80%		Klasse IQG	1.05%
	Klasse S1N	0.70%		Klasse IQG EUR H	1.05%
	Klasse S1N USD	0.70%		Klasse N	2.30%
American Growth				Klasse ND	2.30%
Portfolio	Klasse S	0.15%		Klasse S1	0.85%
	Klasse S EUR H(j)	0.15%		Klasse S1 CHF H	0.85%
	Klasse S1	0.80%		Klasse S1 EUR H	0.85%
	Klasse S1 EUR H	0.80%		Klasse S1 GBP H	0.85%
	Klasse SD	0.15%		Klasse S1D JPY H	0.85%
	Klasse SK	0.85%		Klasse S1QG GBP H	0.85%
All Market Income			China A Shares Equity		
Portfolio	Klasse A	1.85%	Portfolio	Klasse A	1.99%
	Klasse A CHF H	1.85%		Klasse A AUD H	1.99%
	Klasse A EUR H	1.85%		Klasse A CAD H	1.99%
	Klasse A HKD	1.85%		Klasse A EUR	1.99%
	Klasse A SGD H	1.85%		Klasse A HKD H	1.99%
	Klasse A2X	1.65%		Klasse A NZD H	1.99%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
China A Shares Equity		
Portfolio (Fortsetzung)	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 S1 GBP	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%
	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%
Low Volatility Total Return		
Equity Portfolio	Klasse A	1.90%
	Klasse A AUD H	1.90%
	Klasse A CAD H	1.90%
	Klasse A EUR H	1.90%
	Klasse A GBP H	1.90%
	Klasse A HKD	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 GBP H	1.90%
	Klasse AD HKD	1.90%
	Klasse AD NZD H	1.90%
	Klasse AD SGD H	1.90%
	Klasse I	1.10%
	Klasse I EUR H	1.10%
	Klasse I PLN H	1.10%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 JPY H	0.65%

AB SICAV I–	Anteilklasse	%
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 INN AUD H	0.63%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.55%
	Klasse S1 GBP H	0.55%
	Klasse S1 USD H	0.55%
Event Driven Portfolio	Klasse I	1.10%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.90%
	Klasse S1 EUR H	0.90%
	Klasse SU	1.05%
Arya European Alpha		
Portfolio	Klasse F	1.33%
	Klasse F CHF H	1.33%
	Klasse F JPY(k)	1.33%
	Klasse I	1.83%
	Klasse S	0.33%
	Klasse S GBP H	0.33%
	Klasse SU	1.83%
	Klasse Z	0.01%
	Klasse Z USD	0.01%

- (a) Die Anteilklasse wurde am 20. Mai 2021 aufgelöst.
(b) Die Anteilklasse wurde am 29. Januar 2021 aufgelöst.
(c) Die Anteilklasse wurde am 10. Mai 2021 aufgelöst.
(d) Die Anteilklasse wurde am 6. November 2020 aufgelöst.
(e) Die Anteilklasse wurde am 9. Dezember 2020 aufgelöst.
(f) Die Anteilklasse wurde am 30. September 2020 aufgelöst.
(g) Die Anteilklasse wurde am 25. Juni 2020 aufgelöst.
(h) Die Anteilklasse wurde am 31. März 2021 aufgelöst.
(i) Die Anteilklasse wurde am 23. Dezember 2020 aufgelöst.
(j) Die Anteilklasse wurde am 11. Mai 2021 aufgelöst.
(k) Im Laufe des Geschäftsjahres mit Wirkung zum 8. Januar 2021 von 1.30% auf 1.33% gesenkt.

Folgende Tabelle gibt Aufschluss über die von der Verwaltungsgesellschaft getragenen Aufwendungen während des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2021 und die Forderungen aus Aufwandserstattungen zum 31. Mai 2021:

AB SICAV I–	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwands-erstattungen
Global Real Estate Securities		
Portfolio	\$ 41,536	14,499
Sustainable Global Thematic		
Portfolio	\$ 15	6,565
Euro High Yield Portfolio	€ –	20,759
US Small and Mid-Cap		
Portfolio	\$ 107,215	51,967
Emerging Markets Multi-Asset		
Portfolio	\$ 41,344	39,882
Select US Equity Portfolio	\$ 14,031	12,737

AB SICAV I–	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwands- erstattungen
Global Plus Fixed Income Portfolio	\$ 78,556	29,906
Select Absolute Alpha Portfolio ..	\$ 62,742	11,220
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	\$ 361,315	64,731
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	\$ 125,337	59,953
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	\$ 105,053	42,983
US High Yield Portfolio	\$ 199,850	50,334
Global Dynamic Bond Portfolio ..	£ 1,203	1,203
Concentrated US Equity Portfolio	\$ 386,208	87,697
Concentrated Global Equity Portfolio	\$ 219,446	133,381
Global Income Portfolio	\$ 180,350	85,953
Alternative Risk Premia Portfolio	\$ 304,003	54,313
Eurozone Equity Portfolio	€ 4,932	4,984
All Market Income Portfolio	\$ 1,262	1,266
China A Shares Equity Portfolio	CNH 1,440,677	1,426,263
Financial Credit Portfolio	\$ 220,490	41,531
Low Volatility Total Return Equity Portfolio	\$ 220,903	167,841
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	€ 108,767	36,771
Arya European Alpha Portfolio ..	€ 223,153	97,256

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 Aufwands-erstattungen 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 Anteil-klassen 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 350 bis 370) 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 Klasse BX und die entsprechenden Anteile der Klasse H unterliegen 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 Register- 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 Register- und Transferstelle des Fonds zur Verfügung stellt. Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021 belief sich diese Vergütung auf \$11,631,600.

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 2021 belief sich diese Vergütung auf \$2,027,193. 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 Herr Yves Prussen, Mitglied des Verwaltungsrats der Verwaltungsgesellschaft, und Frau Olivia Moessner, Verwaltungsratsmitglied des Fonds, Partner sind) für juristische Dienstleistungen, die gegenüber dem Fonds erbracht werden. Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021 wurde eine Vergütung in Höhe von €127,708 entrichtet, die in der „Gebühr für professionelle Dienstleistungen“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten ist.

Der Anlageverwalter hat keine Geschäfte bezüglich einer Platzierung und/oder Neuemission abgeschlossen, an der eine verbundene Person als Mitglied des Übernahmekonsortiums wesentlich beteiligt 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 \$1,991,657. Dies entspricht einem Prozentsatz von weniger als 0.01% aller Transaktionen. Es wurde eine Provision in Höhe von \$42 für den Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021 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 US High Yield Portfolio und das Global Income Portfolio investieren in das AB FCP I – Mortgage Income Portfolio, ein von der Verwaltungsgesellschaft verwaltetes Portefeuille.

Die Verwaltungsratsmitglieder des Fonds haben Anspruch auf eine Vergütung ihrer Leistungen. Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021 beliefen sich diese abgegrenzten Vergütungen auf \$99,343. Der Betrag ist unter „Sonstiges“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten.

ANMERKUNG F: Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen

Im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021 hat der Anlageverwalter und jeder verbundene Unteranlageverwalter (sofern vorhanden), soweit nach geltendem Recht zulässig, Ausgleichsprovisionen/-vereinbarungen mit Brokern in Bezug auf Portefeuilles des Fonds erhalten bzw. abgeschlossen, die in Aktienwerte 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 Fondsmäglerselskab 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 Computer-Software 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 Anlageportefeuille sowie in „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ und „Veränderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Anlagen“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung

und Veränderung des Fondsvermögens 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 2021 entstanden sind, aufgeführt:

AB SICAV I–	Transaktionskosten
International Health Care Portfolio	\$ 475,355
International Technology Portfolio	\$ 633,489
Global Real Estate Securities Portfolio	\$ 50,069
Sustainable Global Thematic Portfolio	\$ 1,502,803
India Growth Portfolio	\$ 456,543
Euro High Yield Portfolio	€ 1,511
US Small and Mid-Cap Portfolio	\$ 62,396
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	\$ 2,526,125
RMB Income Plus Portfolio CNH	127,539
Short Duration High Yield Portfolio	\$ 11,751
Select US Equity Portfolio	\$ 1,570,048
Global Plus Fixed Income Portfolio	\$ 36,480
Select Absolute Alpha Portfolio	\$ 396,620
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	\$ 389,613
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	\$ 50,985
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	\$ 209
US High Yield Portfolio	\$ 2,740
Low Volatility Equity Portfolio	\$ 2,190,815
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	\$ 1,794,520
Global Dynamic Bond Portfolio	£ 28,884
Concentrated US Equity Portfolio	\$ 73,080
Concentrated Global Equity Portfolio	\$ 283,567
Global Core Equity Portfolio	\$ 766,083
Global Income Portfolio	\$ 14,559
Alternative Risk Premia Portfolio	\$ 90,825
European Equity Portfolio	€ 1,061,841
Eurozone Equity Portfolio	€ 1,018,695
American Growth Portfolio	\$ 298,999
All Market Income Portfolio	\$ 694,604
China A Shares Equity Portfolio CNH	5,657,463
Financial Credit Portfolio	\$ -0-
Low Volatility Total Return Equity Portfolio	\$ 116,807
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	€ 352
Event Driven Portfolio	\$ 46,933
Arya European Alpha Portfolio	€ -0-

ANMERKUNG G: Devisentermingeschäfte

Ein Devisentermingeschäft ist eine Verpflichtung zu einem späteren Kauf oder Verkauf einer Fremdwährung zu einem vereinbarten Terminsatz. Der Gewinn bzw. Verlust, der sich aus dem Unterschied zwischen dem ursprünglichen Vertrag und der Glattstellung dieses Vertrags ergibt, wird in der Ertrags-

und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ verbucht.

Wertschwankungen offener Devisentermingeschäfte werden zu Finanzberichterstattungszwecken unter „Unrealisierte Wert-

steigerung/(-minderung) aus Devisentermingeschäften“ in der Zusammensetzung des Fondsvermögens berücksichtigt.

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

keit 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 Nettoinventarwert 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 Devisentermingeschäfte, einschließlich solcher, die zur Absicherung auf Anteilklassenebene verwendet werden.

ANMERKUNG H: Pensionsgeschäfte

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

Zum 31. Mai 2021 gab es keine Pensionsgeschäfte.

Während des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2021 wurden keine Zinserträge aus Pensionsgeschäften verzeichnet.

ANMERKUNG I: Umgekehrte Pensionsgeschäfte

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

Differenz zwischen dem Verkaufs- und Rückkaufpreis der Wertpapiere, geringer sind als die Kosten, die ansonsten damit verbunden wären, die Geldsumme zu erhalten, die in die Portfeuille-Wertpapiere investiert ist.

Zum 31. Mai 2021 haben die umgekehrten Pensionsgeschäfte und die entsprechenden ausstehenden Sicherheiten folgenden Wert:

AB SICAV I–	Wert	Marktwert der
		Sicherheiten
Global Income Portfolio	\$ 3,142,813	3,047,656

Die Zinsaufwendungen aus umgekehrten Pensionsgeschäften beliefen sich während des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2021 für das Global Income Portfolio insgesamt auf \$1,337.

Solche Transaktionen sind nur von Vorteil, wenn die „Zinskosten“ des Fonds bei einem umgekehrten Pensionsgeschäft, d. h. die

ANMERKUNG J: Finanzterminkontrakte

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

Zu dem Zeitpunkt, an dem der Fonds einen Finanzterminkontrakt abschließt, hinterlegt und hält er beim Broker die von der Börse, an der der Kontrakt abgeschlossen wird, erforderliche 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 K: 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 „Änderung 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 L: 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 Anspruchs auf die Sicherheiten, falls der Entleiher in Konkurs geht. Darüber hinaus wird ein Portefeuille dem Risiko ausgesetzt sein, dass der Erlös aus dem Verkauf jeglicher Sicherheiten, der nach dem Zahlungsverzug des Entleihers realisiert wird, nicht ausreicht, um die verliehenen Wertpapiere zu ersetzen.

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

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

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

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

Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021 erwirtschafteten die Portefeuilles einen Netto-Gebührentrag, der in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen ist.

Für das Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021 verdiente Brothers Harriman & Co. (in ihrer Funktion als Wertpapierleihagent) ein Honorar von \$563,960 für die Bereitstellung von Wertpapierleihdiensten. Dieses Honorar ist in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen.

Die zum 31. Mai 2021 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		
Merrill Lynch	\$ 12,399,662	14,543,039
UBS AG	\$ 8,779,146	11,061,290
Citigroup Global Markets Limited	\$ 2,763,621	3,023,431

AB SICAV I–	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Real Estate Securities Portfolio		
UBS AG	\$ 116,646	146,967
Merrill Lynch	\$ 70,156	82,282
Sustainable Global Thematic Portfolio		
Citigroup Global Markets Limited	\$ 59,276,297	64,848,904
Merrill Lynch	\$ 36,290,071	42,563,086
Credit Suisse	\$ 12,869,212	13,514,996
UBS AG	\$ 6,185,466	7,793,381
US Small and Mid-Cap Portfolio		
Merrill Lynch	\$ 46,872	54,974
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio		
Citigroup Global Markets Limited	\$ 543,372	594,455

AB SICAV I–	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Select Absolute Alpha Portfolio . . .		
Citigroup Global Markets Limited	\$ 3,168,854	3,466,761
UBS AG	\$ 2,927,028	3,687,911
Merrill Lynch	\$ 194,021	227,559
Low Volatility Equity Portfolio . . .		
Barclays	\$ 43,698,708	45,908,069
Morgan Stanley	\$ 3,180,078	3,339,661
Global Core Equity Portfolio		
Citigroup Global Markets Limited	\$ 26,603,949	29,105,005
UBS AG	\$ 16,482,272	20,766,849
Morgan Stanley	\$ 1,665,944	1,749,546
Merrill Lynch	\$ 818,141	959,563
Eurozone Equity Portfolio		
Societe Generale	€ 25,451,487	26,724,197

ANMERKUNG M: 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 N: 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 Glatstellungstransaktion, einschließlich Händlerprovisionen, wird ebenfalls als realisierter Gewinn behandelt, bzw. als realisierter Verlust, wenn die erhaltene Prämie geringer ist als der bezahlte Betrag für die Glatstellungstransaktion. Wird eine Kaufoption ausgeübt, wird die Prämie zum Erlös aus dem Verkauf des zugrunde

liegenden Wertpapiers oder der Währung addiert, um zu ermitteln, ob der Fonds einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wird eine Verkaufsoption ausgeübt, wird die erhaltene Prämie von den Kosten des vom Fonds gekauften Wertpapiers oder der gekauften Währung abgezogen. Beim Verkauf einer Option trägt der Fonds das Marktrisiko, dass sich der Kurs des Wertpapiers oder der Währung, das bzw. die der verkauften Option zugrunde liegt, ungünstig verändert.

Die Ausübung einer vom Fonds verkauften Option könnte dazu führen, dass der Fonds ein Wertpapier oder eine Währung zu einem Preis kauft bzw. verkauft, der vom aktuellen Marktwert abweicht.

Der Fonds kann auch in Optionen auf Swap-Vereinbarungen, sogenannte Swaptions, investieren. Eine Swaption ist eine Option, die dem Käufer das Recht gibt, jedoch nicht die Verpflichtung, zu einem Zeitpunkt in der Zukunft im Austausch gegen Zahlung einer marktüblichen Prämie ein Swap-Geschäft abzuschließen.

Eine Receiver Swaption gibt dem Erwerber das Recht auf Empfang der Gesamrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Eine Payer Swaption gibt dem Erwerber das Recht auf Zahlung der Gesamrendite eines bestimmten Vermögenswertes, eines Referenzsatzes oder eines Index. Swaptions enthalten ferner Optionen, die es ermöglichen, ein bestehendes Swap-Geschäft durch einen der Kontrahenten zu beenden oder zu verlängern.

ANMERKUNG O: Sicherheiten

In der folgenden Tabelle sind die Barsicherheiten aufgeführt, die von Brokern für bestimmte Finanzderivate zum 31. Mai 2021 gehalten oder die diesen dafür geschuldet wurden:

AB SICAV I–	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker geschuldete Barmittel
Sustainable Global Thematic Portfolio		
Barclays	\$ 255,646	–
Deutsche Bank	\$ 548,514	–
Goldman Sachs	\$ –	718,946
JPMorgan Chase	\$ 418,054	1,782,169
Standard Chartered	\$ 39,180	–
Euro High Yield Portfolio		
Goldman Sachs	€ 418,512	250,926
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio		
Bank of America	\$ 880,000	–
Barclays	\$ –	310,000
Citibank	\$ –	570,000
Goldman Sachs	\$ 45,650,521	42,896,225
HSBC Bank	\$ –	300,000
Morgan Stanley	\$ 8,751,830	4,664,153
RBS – Natwest Markets	\$ 290,000	–
Standard Chartered	\$ –	327,000
UBS AG	\$ 124,000	–
RMB Income Plus Portfolio		
Citibank	CNH 25,380,128	1,173
Morgan Stanley	CNH 32,873,258	1,620,115
Short Duration High Yield Portfolio		
Citibank	\$ 82	1,759,000
Credit Suisse	\$ –	1,220,000
Deutsche Bank	\$ 1,320,000	–
Goldman Sachs	\$ 4,060,000	–
Morgan Stanley	\$ 10,258,936	8,487,263
Global Plus Fixed Income Portfolio		
Citibank	\$ 1,046,590	212,083
Credit Suisse	\$ 1,760,320	–
Goldman Sachs	\$ 2,028,873	1,421,913
Morgan Stanley	\$ –	540,000
Select Absolute Alpha Portfolio . .		
Morgan Stanley	\$ 1,497,043	–
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio		
Barclays	\$ –	250,000
Citibank	\$ –	260,000
JPMorgan Chase	\$ 90,000	–
Morgan Stanley	\$ 3,843,806	7,732
Standard Chartered	\$ –	263,000
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio		
Goldman Sachs	\$ 378,581	240,276

AB SICAV I–	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker geschuldete Barmittel
Emerging Market Corporate Debt Portfolio		
Citibank	\$ 436,943	–
Morgan Stanley	\$ 81,957	–
US High Yield Portfolio		
Citibank	\$ 299	–
Credit Suisse	\$ –	260,000
Goldman Sachs	\$ 293,000	–
Morgan Stanley	\$ 1,333,865	1,361,293
Low Volatility Equity Portfolio . .		
Goldman Sachs	\$ 500,000	–
Global Dynamic Bond Portfolio . .		
Barclays	£ 69,055	–
Citibank	£ 6,230,946	1,569,282
Goldman Sachs	£ 475,130	–
JPMorgan Chase	£ –	141,815
Morgan Stanley	£ –	650,389
Global Income Portfolio		
Citibank	\$ 1,256,632	27,581
Deutsche Bank	\$ 572,000	–
Goldman Sachs	\$ 700,000	–
Morgan Stanley	\$ 779,079	207,165
Alternative Risk Premia Portfolio		
Bank of America	\$ 425,000	–
Citibank	\$ 260,000	–
Goldman Sachs	\$ 3,583,683	1,124,516
JPMorgan Chase	\$ 1,073,300	–
Morgan Stanley	\$ 6,378,345	3,182,836
Low Volatility Total Return Equity Portfolio		
Goldman Sachs	\$ 6,468,897	–
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio		
Citibank	€ 50,501	4,941
Event Driven Portfolio		
Bank of America	\$ 348,000	–
Goldman Sachs	\$ 22,156,736	–
JPMorgan Chase	\$ 5,161,701	–
Morgan Stanley	\$ 16,790,086	–
Arya European Alpha Portfolio . .		
Goldman Sachs	€ 1,580,187	632,314
Morgan Stanley	€ –	2,857,026

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

In Bezug auf die am 31. Mai 2021 von den einzelnen Portefeuilles 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	AB SICAV I–	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio			Goldman Sachs U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 624,027	–
Deutsche Bank U.S. Treasury Bill, 0.00%, 08/05/2021	\$ –	306,989	JPMorgan Chase U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 2,328,038	–
Global Plus Fixed Income Portfolio			Morgan Stanley U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 1,063,222	–
Goldman Sachs U.S. Treasury Bonds, 4.50%, 08/15/2039	\$ 4,296,693	–	U.S. Treasury Notes, 0.88%, 11/15/2030	\$ 1,899,578	–
Select Absolute Alpha Portfolio . . .			UBS AG U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 675,692	–
Morgan Stanley U.S. Treasury Bill, 0.00%, 07/15/2021	\$ 230,897	–	Low Volatility Total Return Equity Portfolio		
U.S. Treasury Bill, 0.00%, 08/05/2021	\$ 2,999,892	–	Goldman Sachs Apple, Inc.	\$ 2,579,427	–
Global Income Portfolio			Microsoft Corp.	\$ 2,871,320	–
Citigroup U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 348,740	–	Philip Morris International, Inc.	\$ 925,728	–
JPMorgan Chase U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 344,389	–	Procter & Gamble Co. (The)	\$ 1,469,865	–
Alternative Risk Premia Portfolio			UnitedHealth Group, Inc.	\$ 1,647,680	–
Goldman Sachs U.S. Treasury Bill, 0.00%, 06/10/2021	\$ 746,799	–	Walmart, Inc.	\$ 1,732,766	–
U.S. Treasury Bill, 0.00%, 07/15/2021	\$ 1,781,379	–	Event Driven Portfolio		
All Market Income Portfolio			Goldman Sachs U.S. Treasury Bill, 0.00%, 10/21/2021	\$ 1,642,970	–
Citigroup U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 291,200	–	JPMorgan Chase U.S. Treasury Bill, 0.00%, 06/10/2021	\$ 1,801,998	–
Credit Suisse U.S. Treasury Notes, 0.63%, 08/15/2030	\$ 537,551	–	U.S. Treasury Bill, 0.00%, 07/15/2021	\$ 1,060,687	–
			U.S. Treasury Bill, 0.00%, 10/21/2021	\$ 1,731,663	–

ANMERKUNG P: Gemeinsame Verwaltung von Vermögenswerten

Zum Zwecke der effizienten Verwaltung kann die Verwaltungsgesellschaft Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb oder außerhalb des Fonds gemeinsam verwalten, wenn dies gemäß der Anlagepolitik des jeweiligen Portefeuilles gestattet ist. In diesem Fall werden die Vermögenswerte verschiedener Portefeuilles gemeinsam verwaltet. Auf gemeinsam verwaltete Vermögenswerte wird als „Pool“ Bezug genommen. Diese Pool-Vereinbarungen dienen dazu, die operativen und anderen Aufwendungen zu reduzieren; die gesetzlichen Rechte und Pflichten der 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 2021 verwaltet der Fonds die Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb des Fonds unter Verwendung der folgenden Pools gemeinsam:

Pool an Vermögenswerten

AB – Global Growth Pool

Beteiligte Portefeuilles

Sustainable Global Thematic Portfolio

ANMERKUNG Q: 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 R: 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 Anteilhaber 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 Niveau des Index und dem am Bewertungszeitpunkt des letzten Geschäftstages des aktuellen Geschäftsjahres des Portefeuilles berechneten Niveau des Index berechnet und als Prozentsatz ausgedrückt.

Die Portefeuille-Performance im Hinblick auf ein Geschäftsjahr wird als die Differenz zwischen dem bereinigten Eröffnung-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 unrealisierte 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.

Für die folgenden Anteilklassen (und die entsprechenden H-Klassen) wird keine Leistungsgebühr berechnet: A, AR, C, I, N, S, S1 und F.

Zum 31. Mai 2021 beliefen sich die durch das Select US Equity Portefeuille zahlbaren Leistungsgebühren auf \$4,418,188. Diese sind im Posten „Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten“ in der Zusammensetzung des Fondsvermögens ausgewiesen.

Select Absolute Alpha Portfolio

In der Regel erhält der Anlageverwalter vom Portefeuille 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 Portefeuilles 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.

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 die Leistungsgebühren nach der Rücknahme von Anteilen ausgewiesen werden, nicht zurückgesetzt.

Bei der Berechnung der Leistungsgebühr 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 Anteile der Klasse H infolge der Auswirkungen von Währungsabsicherungen den „Prior High NAV“ übersteigt.

Für die folgenden Anteilklassen (und die entsprechenden H-Klassen) wird keine Leistungsgebühr berechnet: S.

Zum 31. Mai 2021 beliefen sich die durch das Select Absolute Alpha Portfolio zahlbaren Leistungsgebühren auf \$26,314,712. Diese sind im Posten „Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten“ in der Zusammensetzung des Fondsvermögens ausgewiesen.

Arya European Alpha Portfolio

Am Ende eines jeden Geschäftsjahres erhält der Anlageverwalter 20% (15% für Anteile der Klasse F) des Betrags, um den der „bereinigte NIW“ (wie unten definiert) jeder der betreffenden Anteilklassen die „High Water Mark“ (wie unten definiert) am Ende eines Geschäftsjahres übersteigt.

Berechnungsmethode:

Für jede Anteilklasse wird die Leistungsgebühr an jedem Geschäftstag abgegrenzt und basiert auf dem „gewichteten

Durchschnitt“ der im Umlauf befindlichen Anteile (wie unten definiert), solange der gewichtete Durchschnitt dieser Anteile die am Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindlichen Anteile nicht um 20% oder mehr übersteigt. In Fällen, in denen der gewichtete Durchschnitt der Anteile die am Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindlichen Anteile um 20% oder mehr übersteigt, wird die Leistungsgebühr auf der Grundlage der am Ende des Geschäftsjahres im Umlauf befindlichen Anteile berechnet.

Veranschaulichendes Beispiel:

Wenn am Ende eines Geschäftsjahres der bereinigte NIW für die Anteilklasse SU (EUR 10.50) die geltende High Water Mark (EUR 10.00) übersteigt, erhält der Anlageverwalter die Leistungsgebühr, die gemäß der oben beschriebenen Methode berechnet wird.

- Outperformance (je Anteil): EUR 0.50 (10.50 abzüglich 10.00)
- Leistungsgebühr (je Anteil): EUR 0.10 (20% der Outperformance, d. h. EUR 0.50)

Nach Zahlung der Leistungsgebühr beträgt die High Water Mark für die Anteilklasse SU nun EUR 10.40 (bereinigter NIW abzüglich der Leistungsgebühr).

Am Ende des folgenden Geschäftsjahres wird der bereinigte NIW für die Anteilklasse SU an der neuen High Water Mark (EUR 10.40) gemessen. Wenn der bereinigte NIW je Anteil der Anteilklasse SU die neue High Water Mark überschreitet, wird die Leistungsgebühr gezahlt, andernfalls wird die Leistungsgebühr nicht gezahlt.

Begriffsbestimmungen:

- „bereinigter NIW“ bezeichnet den Nettoinventarwert je Anteil vor der Reduzierung um die Leistungsgebühr des laufenden Jahres, falls vorgenommen, und nach Reduzierung um alle anderen Kosten und Gebühren.
- „High Water Mark“ bezeichnet für eine Anteilklasse den bereinigten NIW unmittelbar nach Zahlung der letzten Leistungsgebühr oder, wenn keine Leistungsgebühr gezahlt wurde, den NIW dieser Anteilklasse bei Ausgabe.
- Der „gewichtete Durchschnitt der Anteile“ ist die Summe der ausgegebenen Anteile für jede Anteilklasse an jedem Kalendertag des Geschäftsjahres des Portefeuilles, einschließlich der Wochenenden, dividiert durch die Gesamtzahl der Tage in diesem Geschäftsjahr.

Zusätzliche Informationen:

Die High Water Mark für eine Anteilklasse wird nicht zurückgesetzt und ändert sich (d. h. erhöht sich) nur dann, wenn am Ende des Geschäftsjahres eine Leistungsgebühr gezahlt wird. Dementsprechend wird eine Leistungsgebühr erst dann gezahlt, wenn eine unterdurchschnittliche Wertentwicklung der betreffenden Anteilklasse vollständig ausgeglichen wurde.

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

Gegebenenfalls vorgenommene Swing-Pricing-Anpassungen werden bei der Berechnung der Leistungsgebühr nicht berücksichtigt.

Falls eine Anteilklasse, für die eine Leistungsgebühr erhoben wird, zu einem anderen Zeitpunkt als zum Ende eines Geschäftsjahres zurückgenommen wird, wird eine Leistungsgebühr in Bezug auf diese Anteilklasse für den betreffenden Teil des Geschäftsjahres ermittelt und an dem entsprechenden Datum gezahlt. Die High Water Mark wird an den Geschäftstagen, an denen die Leistungsgebühren nach der Rücknahme von Anteilen ausgewiesen werden, nicht zurückgesetzt.

Bei der Berechnung der Leistungsgebühr 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 bereinigte NIW dieser H-Anteile nach Ausschluss der Auswirkungen von Währungsabsicherungsgeschäften die High Water Mark überschreitet.

Für die folgenden Anteilklassen (und die entsprechenden H-Klassen) wird keine Leistungsgebühr berechnet: S und Z.

Zum 31. Mai 2021 war für das Arya European Alpha Portfolio keine Leistungsgebühr zahlbar.

ANMERKUNG S: Ereignisse nach dem Bilanzstichtag

Der Verwaltungsrat beschloss, die Auflegung neuer Portefeuilles innerhalb des Fonds zu genehmigen: AB SICAV I – Sustainable Income Portfolio und AB SICAV I – US Low Volatility Equity Portfolio. Die Portefeuilles nahmen ihre Geschäftstätigkeit am 14. Juni 2021 bzw. am 16. Juni 2021 auf.

Der Verwaltungsrat beschloss, bestimmte Anteilklassen bestimmter Portefeuilles des Fonds zum 15. Juli 2021 aufzuteilen.

Der Verwaltungsrat beschloss, die Preisstruktur der Anteilklasse W des AB SICAV I - Select US Equity Portfolio zum 1. Juni 2021 wie folgt zu ändern:

- die Verwaltungsgebühr wurde von 0.20% auf 0.45% angehoben;
- die Leistungsgebühr wurde abgeschafft; und
- die freiwillige Verpflichtung der Verwaltungsgesellschaft, bestimmte Gesamtgebühren und -aufwendungen (freiwillige Gebührenobergrenze) in Bezug auf die Anteilklasse W von ihren Gebühren abzuziehen (oder anderweitig zu übernehmen), wurde infolge der Erhöhung der Verwaltungsgebühr von 0.40% auf 0.65% angehoben.

TABELLE 1

GEBÜHRENSTRUKTUR

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<u>International Health Care Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.76%(1)	0.05%	N/A	1.97%
A EUR H	1.76%(1)	0.05%	N/A	2.00%
AD	1.76%(1)	0.05%	N/A	1.99%
AX	1.26%(2)	0.05%	N/A	1.47%
B	1.76%(1)	0.05%	1.00%	2.95%
BX	1.26%(2)	0.05%	N/A	1.46%
C	2.21%(3)	0.05%	N/A	2.42%
ED	1.76%(1)	0.05%	1.00%	2.97%
I	0.96%(4)	0.05%	N/A	1.17%
I GBP	0.96%(4)	0.05%	N/A	1.20%
S1	0.90%	0.01%(13)	N/A	1.05%
S14 GBP	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.68%
<u>International Technology Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.82%(5)	0.05%	N/A	2.05%
A AUD H	2.00%(5)	0.05%	N/A	2.83%
A PLN H	1.82%(5)	0.05%	N/A	2.04%
B	1.82%(5)	0.05%	1.00%	3.04%
C	2.27%(6)	0.05%	N/A	2.49%
E	1.81%(5)	0.05%	1.00%	3.06%
I	1.02%(7)	0.05%	N/A	1.24%
S1	0.90%	0.01%(13)	N/A	1.01%
<u>Global Real Estate Securities Portfolio</u>				
Klasse				
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(a)	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%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<u>Sustainable Global Thematic Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.68%(8)	0.05%	N/A	1.92%
A AUD H	1.68%(8)	0.05%	N/A	1.93%
A CAD H	1.67%(8)	0.05%	N/A	1.90%
A EUR H	1.67%(8)	0.05%	N/A	1.93%
A SGD H	1.66%(8)	0.05%	N/A	1.93%
AN	1.69%(8)	0.05%	N/A	1.92%
AX	1.69%(8)	0.05%	N/A	1.92%
AXX	1.19%(9)	0.05%	N/A	1.42%
B	1.70%(8)	0.05%	1.00%	2.93%
B CAD H(b)	1.70%(8)	0.05%	1.00%	2.93%
BX	1.69%(8)	0.05%	1.00%	2.93%
BXX	1.19%(9)	0.05%	N/A	1.43%
C	2.13%(10)	0.05%	N/A	2.38%
CX	2.14%(10)	0.05%	N/A	2.37%
E	1.66%(8)	0.05%	1.00%	3.01%
E AUD H	1.66%(8)	0.05%	1.00%	2.95%
I	0.88%(11)	0.05%	N/A	1.12%
I AUD	0.86%(11)	0.05%	N/A	1.17%
I AUD H	0.85%(11)	0.05%	N/A	1.45%
I EUR H	0.89%(11)	0.05%	N/A	1.12%
IN	0.89%(11)	0.05%	N/A	1.12%
IX	0.89%(11)	0.05%	N/A	1.13%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S GBP	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.78%
S1 AUD	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.80%
S1 AUD H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.80%
S1 JPY	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.79%
S1X	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.78%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
SX	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
<u>India Growth Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.75%	0.05%	N/A	2.23%
A PLN H	1.75%	0.05%	N/A	2.47%
A SGD H	1.75%	0.05%	N/A	2.24%
AD AUD H	1.75%	0.05%	N/A	2.22%
AX	1.55%(12)	0.05%	N/A	2.05%
B	1.75%	0.05%	1.00%	3.20%
BX	1.55%(12)	0.05%	1.00%	3.01%
C	2.20%	0.05%	N/A	2.67%
I	0.95%	0.05%	N/A	1.45%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.29%
S1	0.95%	0.01%(13)	N/A	1.25%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<u>Euro High Yield Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.20%	0.05%	N/A	1.45%
A2	1.20%	0.05%	N/A	1.45%
A2 CHF H	1.20%	0.05%	N/A	1.41%
A2 PLN H	1.20%	0.05%	N/A	1.45%
A2 USD H	1.20%	0.05%	N/A	1.45%
AA	1.20%	0.05%	N/A	1.45%
AA AUD H	1.20%	0.05%	N/A	1.45%
AA HKD H	1.20%	0.05%	N/A	1.41%
AA RMB H	1.20%	0.05%	N/A	1.43%
AA SGD H	1.20%	0.05%	N/A	1.41%
AA USD H	1.20%	0.05%	N/A	1.46%
AR	1.20%	0.05%	N/A	1.44%
AT	1.20%	0.05%	N/A	1.45%
AT AUD H	1.20%	0.05%	N/A	1.41%
AT SGD H	1.20%	0.05%	N/A	1.41%
AT USD H	1.20%	0.05%	N/A	1.45%
B2	1.20%	0.05%	1.00%	2.44%
C	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
C2	1.65%	0.05%	N/A	1.89%
CT USD H	1.65%	0.05%	N/A	1.89%
I	0.65%	0.05%	N/A	0.91%
I2	0.65%	0.05%	N/A	0.90%
I2 CHF H	0.65%	0.05%	N/A	0.86%
I2 GBP H	0.65%	0.05%	N/A	0.85%
I2 USD H	0.65%	0.05%	N/A	0.90%
IT USD H	0.65%	0.05%	N/A	0.90%
NT USD H	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.13%
S1	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.73%
S1 USD H	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.70%
<u>US Small and Mid-Cap Portfolio</u>				
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(c)	1.60%	0.05%	N/A	2.00%
B(d)	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	0.15%
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%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio				
Klasse				
A	1.60%	0.05%	N/A	1.88%
A AUD H	1.60%	0.05%	N/A	1.88%
A CAD H	1.60%	0.05%	N/A	1.91%
A CHF H	1.60%	0.05%	N/A	1.88%
A EUR H	1.60%	0.05%	N/A	1.89%
A GBP H	1.60%	0.05%	N/A	1.89%
A SGD H	1.60%	0.05%	N/A	1.88%
AD	1.60%	0.05%	N/A	1.88%
AD AUD H	1.60%	0.05%	N/A	1.88%
AD CAD H	1.60%	0.05%	N/A	1.89%
AD EUR H	1.60%	0.05%	N/A	1.89%
AD GBP H	1.60%	0.05%	N/A	1.90%
AD RMB H	1.60%	0.05%	N/A	1.91%
AD SGD H	1.60%	0.05%	N/A	1.88%
AD ZAR H	1.60%	0.05%	N/A	1.88%
AR	1.60%	0.05%	N/A	1.90%
AR EUR H	1.60%	0.05%	N/A	1.89%
B	1.60%	0.05%	1.00%	2.88%
BD	1.60%	0.05%	1.00%	2.87%
C	2.05%	0.05%	N/A	2.34%
ED	1.60%	0.05%	1.00%	2.93%
ED AUD H	1.60%	0.05%	1.00%	2.93%
ED ZAR H	1.60%	0.05%	1.00%	2.93%
I	0.80%	0.05%	N/A	1.09%
I CHF H	0.80%	0.05%	N/A	1.09%
I EUR H	0.80%	0.05%	N/A	1.09%
I GBP	0.80%	0.05%	N/A	1.08%
I GBP H	0.80%	0.05%	N/A	1.09%
ID	0.80%	0.05%	N/A	1.08%
ID GBP H	0.80%	0.05%	N/A	1.10%
N	2.05%	0.05%	N/A	2.34%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.80%	0.01%(13)	N/A	0.95%
S1 JPY	0.80%	0.01%(13)	N/A	0.95%
S1 JPY H	0.80%	0.01%(13)	N/A	0.95%
S1D	0.80%	0.01%(13)	N/A	0.95%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
SQD GBP H(e)	N/A	0.01%(13)	N/A	0.14%

RMB Income Plus Portfolio

Klasse				
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AR EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.82%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
IT	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.14%
S1	0.55%	0.01%(13)	N/A	0.69%
W2	0.39%(14)	0.05%	N/A	0.64%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Short Duration High Yield Portfolio				
Klasse				
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
A2 GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.41%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AR EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
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	1.33%
B2	1.10%	0.05%	1.00%	2.31%
BT	1.10%	0.05%	1.00%	2.31%
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	0.78%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
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	0.76%
IT GBP H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
IT SGD H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.62%
S1QD EUR H(f)	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.59%
W2 CHF H	0.39%(14)	0.05%	N/A	0.61%

Select US Equity Portfolio

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Klasse				
A	1.80%	0.05%	N/A	2.01%
A AUD H	1.80%	0.05%	N/A	2.02%
A CHF H	1.80%	0.05%	N/A	2.01%
A CZK H	1.80%	0.05%	N/A	2.02%
A EUR H	1.80%	0.05%	N/A	2.04%
A GBP H	1.80%	0.05%	N/A	2.01%
A PLN H	1.80%	0.05%	N/A	2.10%
A SGD H	1.80%	0.05%	N/A	2.01%
AR	1.80%	0.05%	N/A	2.01%
AR EUR H	1.80%	0.05%	N/A	2.01%
C	2.25%	0.05%	N/A	2.46%
F	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.57%
F EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.58%
I	1.00%	0.05%	N/A	1.21%
I CHF H	1.00%	0.05%	N/A	1.21%
I EUR H	1.00%	0.05%	N/A	1.21%
I GBP H	1.00%	0.05%	N/A	1.19%
I SGD H	1.00%	0.05%	N/A	1.21%
N	2.25%	0.05%	N/A	2.46%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
S1	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.83%
S1 EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.85%
S1 GBP H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.83%
S1 JPY	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.81%
S1 JPY H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.81%
S1 SGD H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.80%
W	0.20%	0.05%	N/A	0.39%
W CHF H	0.20%	0.05%	N/A	0.38%
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%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Global Plus Fixed Income Portfolio				
Klasse				
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	0.86%
2 EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.87%
2 GBP H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.85%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AR EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AT CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
AT EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
BT(b)	1.10%	0.05%	1.00%	2.32%
BT CAD H(b)	1.10%	0.05%	1.00%	2.33%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.81%
C2 EUR H	1.55%	0.05%	N/A	1.81%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.77%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.81%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.88%
I2 GBP H	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
IK EUR H(g)	0.55%	0.05%	N/A	0.61%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.12%
S CAD H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.11%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.61%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.58%
SA	N/A	0.01%(13)	N/A	0.11%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Select Absolute Alpha Portfolio				
Klasse				
A	1.80%	0.05%	N/A	2.08%
A AUD H	1.80%	0.05%	N/A	2.05%
A CHF H	1.80%	0.05%	N/A	2.07%
A EUR H	1.80%	0.05%	N/A	2.08%
A GBP H	1.80%	0.05%	N/A	2.08%
A PLN H	1.80%	0.05%	N/A	2.12%
A SGD H	1.80%	0.05%	N/A	2.07%
C	2.25%	0.05%	N/A	2.53%
F	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.64%
F EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.64%
I	1.00%	0.05%	N/A	1.27%
I CHF H	1.00%	0.05%	N/A	1.28%
I EUR H	1.00%	0.05%	N/A	1.29%
I GBP H	1.00%	0.05%	N/A	1.28%
N	2.25%	0.05%	N/A	2.53%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.14%
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	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.15%
S1 EUR H	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.14%
S1 GBP H	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.10%
S1 JPY H	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.14%
S13 EUR H	0.99%	0.01%(13)	N/A	0.99%
W	0.80%(15)	0.05%	N/A	1.05%
W CHF H	0.80%(15)	0.05%	N/A	1.05%
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio				
Klasse				
A2	1.30%	0.05%	N/A	1.62%
A2 CZK H	1.30%	0.05%	N/A	1.60%
A2 EUR H	1.30%	0.05%	N/A	1.66%
A2 PLN H	1.30%	0.05%	N/A	1.64%
AA	1.30%	0.05%	N/A	1.63%
AT	1.30%	0.05%	N/A	1.62%
AT SGD H	1.30%	0.05%	N/A	1.60%
I2	0.75%	0.05%	N/A	1.07%
I2 EUR H	0.75%	0.05%	N/A	1.06%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.85%
SA	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
ZT	N/A	N/A	N/A	0.01%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio				
Klasse				
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(b)	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT(h)	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT AUD H	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT CAD H(h)	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT EUR H(b)	1.20%	0.05%	1.00%	2.60%
BT GBP H(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%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<u>Emerging Market Corporate Debt Portfolio</u>				
Klasse				
A2	1.30%	0.05%	N/A	1.75%
A2 AUD H	1.30%	0.05%	N/A	1.68%
A2 CAD H	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
A2 EUR H	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
A2 GBP H	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
A2 SGD H	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
AA	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
AA AUD H	1.30%	0.05%	N/A	1.68%
AA SGD H	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
AR EUR	1.30%	0.05%	N/A	1.66%
AT	1.30%	0.05%	N/A	1.67%
AT AUD H	1.30%	0.05%	N/A	1.68%
AT CAD H	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
AT EUR H	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
AT GBP H	1.30%	0.05%	N/A	1.65%
AT NZD H	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
AT RMB H	1.30%	0.05%	N/A	1.68%
AT SGD H	1.30%	0.05%	N/A	1.69%
C2	1.75%	0.05%	N/A	2.14%
CT	1.75%	0.05%	N/A	2.14%
I2	0.75%	0.05%	N/A	1.15%
I2 EUR H	0.75%	0.05%	N/A	1.12%
IT	0.75%	0.05%	N/A	1.13%
N2	1.85%	0.05%	N/A	2.24%
NT	1.85%	0.05%	N/A	2.28%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.85%
ZT	N/A	N/A	N/A	0.01%
<u>US High Yield Portfolio</u>				
Klasse				
A2	1.20%	0.05%	N/A	1.54%
A2 EUR H	1.20%	0.05%	N/A	1.55%
A2 SEK H	1.20%	0.05%	N/A	1.55%
C2	1.65%	0.05%	N/A	1.98%
I2	0.65%	0.05%	N/A	0.98%
I2 EUR H	0.65%	0.05%	N/A	0.95%
I2 SEK H	0.65%	0.05%	N/A	1.00%
IT	0.65%	0.05%	N/A	1.00%
N2	1.75%	0.05%	N/A	2.07%
NT	1.75%	0.05%	N/A	2.07%
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%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Low Volatility Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
A AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
A EUR	1.50%	0.05%	N/A	1.68%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
A NZD H	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
A PLN H	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
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	1.71%
AD GBP H	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
AD NZD H	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
AD RMB H	1.50%	0.05%	N/A	1.70%
AD SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.72%
AD ZAR H	1.50%	0.05%	N/A	1.74%
AR	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
AR EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.68%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.16%
ED	1.50%	0.05%	1.00%	2.71%
ED AUD H	1.50%	0.05%	1.00%	2.72%
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	0.90%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
I GBP	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
I GBP H	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
I SGD H	0.70%	0.05%	N/A	0.92%
ID	0.70%	0.05%	N/A	0.98%
N	1.95%	0.05%	N/A	2.15%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.07%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.57%
S1 EUR	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.57%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.57%
S1D	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.57%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<u>Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
AD	1.65%	0.05%	N/A	1.91%
AD AUD H	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
AD CAD H	1.65%	0.05%	N/A	1.91%
AD EUR H	1.65%	0.05%	N/A	1.88%
AD GBP H	1.65%	0.05%	N/A	1.86%
AD NZD H	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
AD SGD H	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
F	0.425%	0.01%(13)	N/A	0.55%
F EUR H	0.425%	0.01%(13)	N/A	0.54%
I	0.85%	0.05%	N/A	1.10%
I GBP H	0.85%	0.05%	N/A	1.08%
I SGD H	0.85%	0.05%	N/A	1.09%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.13%
S EUR	N/A	0.01%(13)	N/A	0.13%
S GBP	N/A	0.01%(13)	N/A	0.12%
S1	0.85%	0.01%(13)	N/A	0.96%
<u>Global Dynamic Bond Portfolio</u>				
Klasse				
A2 CHF H	1.00%	0.05%	N/A	1.19%
A2 EUR H	1.00%	0.05%	N/A	1.14%
A2 SGD H	1.00%	0.05%	N/A	1.18%
A2 USD H	1.00%	0.05%	N/A	1.18%
AR EUR H	1.00%	0.05%	N/A	1.18%
I2	0.50%	0.05%	N/A	0.67%
I2 CHF H	0.50%	0.05%	N/A	0.68%
I2 EUR H	0.50%	0.05%	N/A	0.70%
I2 USD H	0.50%	0.05%	N/A	0.68%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.09%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%
S USD H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
S1	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.53%
S1 EUR H	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.49%
S1 SGD H	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.53%
S1 USD H	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.50%
S1QD	0.45%	0.01%(13)	N/A	0.53%
SQD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.08%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<u>Concentrated US Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.60%	0.05%	N/A	1.79%
A AUD H	1.60%	0.05%	N/A	1.79%
A EUR	1.60%	0.05%	N/A	1.79%
A EUR H	1.60%	0.05%	N/A	1.79%
A SGD H	1.60%	0.05%	N/A	1.79%
AR EUR	1.60%	0.05%	N/A	1.79%
C	2.05%	0.05%	N/A	2.26%
I	0.80%	0.05%	N/A	0.94%
I AUD H	0.80%	0.05%	N/A	0.94%
I CHF H	0.80%	0.05%	N/A	0.94%
I EUR H	0.80%	0.05%	N/A	0.94%
I GBP	0.80%	0.05%	N/A	0.94%
I GBP H	0.80%	0.05%	N/A	0.94%
I SGD H	0.80%	0.05%	N/A	0.94%
N	2.05%	0.05%	N/A	2.27%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S1	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.85%
S1 EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.84%
S1 GBP H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.84%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
<u>Concentrated Global Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.70%	0.05%	N/A	1.89%
A EUR H	1.70%	0.05%	N/A	1.89%
A SGD H	1.70%	0.05%	N/A	1.89%
AR EUR	1.70%	0.05%	N/A	1.89%
C	2.15%	0.05%	N/A	2.39%
I	0.85%	0.05%	N/A	0.99%
I CAD H	0.85%	0.05%	N/A	0.99%
I CHF H	0.85%	0.05%	N/A	0.99%
I EUR	0.85%	0.05%	N/A	0.99%
I EUR H	0.85%	0.05%	N/A	0.99%
I GBP	0.85%	0.05%	N/A	0.99%
I GBP H	0.85%	0.05%	N/A	0.99%
N	2.15%	0.05%	N/A	2.36%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.11%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S GBP	N/A	0.01%(13)	N/A	0.11%
S1	0.85%	0.01%(13)	N/A	0.93%
S1 EUR H	0.85%	0.01%(13)	N/A	0.94%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Global Core Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.50%	0.05%	N/A	1.76%
A AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.72%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.73%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
AR EUR	1.50%	0.05%	N/A	1.73%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.18%
I	0.70%	0.05%	N/A	0.93%
I AUD H	0.70%	0.05%	N/A	0.93%
I CHF H	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
I EUR	0.70%	0.05%	N/A	0.92%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	0.93%
I GBP H	0.70%	0.05%	N/A	0.93%
I SGD H	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
INN EUR	0.70%	0.05%	N/A	0.94%
IX EUR	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.75%
N	1.95%	0.05%	N/A	2.20%
RX EUR	1.75%	0.05%	N/A	1.96%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%
S NOK HP	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S1	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.70%
S1 EUR H	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.66%
S1 NOK HP	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.70%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.10%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
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	0.15%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.65%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.65%
S1 GBP H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.65%
Alternative Risk Premia Portfolio				
Klasse				
F	0.35%	0.01%(13)	N/A	0.60%
F EUR H	0.35%	0.01%(13)	N/A	0.60%
F GBP H	0.35%	0.01%(13)	N/A	0.60%
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%
S3 AUD H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
European Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
A AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
A HKD H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
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	1.82%
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	1.82%
B	1.50%	0.10%	1.00%	2.83%
BD AUD H	1.50%	0.10%	1.00%	2.83%
BD USD H	1.50%	0.10%	1.00%	2.82%
C	1.95%	0.10%	N/A	2.27%
C USD H	1.95%	0.10%	N/A	2.28%
I	0.70%	0.10%	N/A	1.02%
I GBP	0.70%	0.10%	N/A	1.00%
I USD H	0.70%	0.10%	N/A	1.03%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.13%
S1	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.73%
S1 GBP	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.71%
S1NN(i)	0.60%	0.01%(13)	N/A	0.74%
S1X	0.55%	0.01%(13)	N/A	0.68%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.13%
Eurozone Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
A AUD H	1.55%	0.10%	N/A	1.85%
A PLN H	1.55%	0.10%	N/A	1.86%
A SGD H	1.55%	0.10%	N/A	1.85%
A USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.85%
AR	1.55%	0.10%	N/A	1.90%
AX	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
BX	1.50%	0.10%	1.00%	2.80%
C	2.00%	0.10%	N/A	2.30%
C USD H	2.00%	0.10%	N/A	2.29%
CX	1.95%	0.10%	N/A	2.25%
I	0.75%	0.10%	N/A	1.05%
I GBP	0.75%	0.10%	N/A	1.06%
I USD H	0.75%	0.10%	N/A	1.05%
INN	0.75%	0.10%	N/A	1.05%
IX	0.70%	0.10%	N/A	1.00%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.11%
S1	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.75%
S1 GBP	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.76%
S1 USD H	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.80%
S1N	0.50%(14)	0.01%(13)	N/A	0.61%
S1N USD	0.50%(14)	0.01%(13)	N/A	0.62%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
American Growth Portfolio				
Klasse				
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	1.75%
A SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.77%
AD	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
AD AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.74%
AD RMB H	1.50%	0.10%	N/A	1.75%
AD ZAR H	1.50%	0.10%	N/A	1.75%
AX	0.92%	0.10%	N/A	1.17%
B	1.50%	0.10%	1.00%	2.73%
BD	1.50%	0.10%	1.00%	2.73%
BD ZAR H	1.50%	0.10%	1.00%	2.72%
BX	0.92%	0.10%	N/A	1.15%
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%	2.75%
I	0.70%	0.10%	N/A	0.94%
I EUR H	0.70%	0.10%	N/A	0.94%
I GBP	0.70%	0.10%	N/A	1.15%
I GBP H	0.70%	0.10%	N/A	0.95%
N	1.95%	0.10%	N/A	2.19%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.06%
S EUR H(j)	N/A	0.01%(13)	N/A	0.04%
S1	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.70%
S1 EUR H	0.65%	0.01%(13)	N/A	0.71%
SD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.05%
SK	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.76%

All Market Income Portfolio

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt- kostenquote*
A	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
A CHF H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
A EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
A HKD	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
A SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
A2X	1.15%	0.10%	N/A	1.47%
AD	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
AD AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AD CAD H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AD EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AD GBP H	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
AD HKD	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AD NZD H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AD RMB H	1.50%	0.10%	N/A	1.85%
AD SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AD ZAR H	1.50%	0.10%	N/A	1.83%
AMG	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
AMG EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
ANN	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
ANN EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AQG	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
AQG EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AR EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AX	1.15%	0.10%	N/A	1.48%
B	1.50%	0.10%	1.00%	2.82%
B2X	1.15%	0.10%	1.00%	2.45%
BX	1.15%	0.10%	1.00%	2.45%
C	1.95%	0.10%	N/A	2.28%
C2X	1.60%	0.10%	N/A	1.92%
CD	1.95%	0.10%	N/A	2.27%
CX	1.60%	0.10%	N/A	1.92%
ED	1.50%	0.10%	1.00%	2.84%
ED AUD H	1.50%	0.10%	1.00%	2.84%
ED ZAR H	1.50%	0.10%	1.00%	2.84%
I	0.70%	0.10%	N/A	1.05%
I CHF H	0.70%	0.10%	N/A	1.01%
I EUR H	0.70%	0.10%	N/A	1.02%
I SGD H	0.70%	0.10%	N/A	1.00%
ID	0.70%	0.10%	N/A	1.01%
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	1.04%
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	2.29%
ND	1.95%	0.10%	N/A	2.25%
S1	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.84%
S1 CHF H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.83%
S1 EUR H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.83%
S1 GBP H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.79%
S1D JPY H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.83%
S1QG GBP H	0.70%	0.01%(13)	N/A	0.79%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
China A Shares Equity Portfolio				
Klasse				
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%
S1 GBP	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.95%
SP1 USD	N/A	0.01%(13)	N/A	0.20%
Financial Credit Portfolio				
Klasse				
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.40%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.85%
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.79%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
I2 GBP H	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
IT	0.55%	0.05%	N/A	0.82%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.12%
S EUR H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.12%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.12%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.62%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.62%
S1 GBP H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.62%
ZT	N/A	N/A	N/A	0.01%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<u>Low Volatility Total Return Equity Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
A AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
A CAD H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
A GBP H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
A HKD	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
A NZD H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
A PLN H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
AD	1.50%	0.05%	N/A	1.88%
AD AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
AD CAD H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
AD GBP H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
AD HKD	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
AD NZD H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
AD SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.90%
I	0.70%	0.05%	N/A	1.06%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	1.10%
I PLN H	0.70%	0.05%	N/A	1.10%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.65%
S1 JPY H	0.50%	0.01%(13)	N/A	0.65%
<u>Sustainable Global Thematic Credit Portfolio</u>				
Klasse				
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%
INN AUD 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%
<u>Event Driven Portfolio</u>				
Klasse				
I	0.80%	0.05%	N/A	1.10%
S	N/A	0.01%(13)	N/A	0.15%
S1	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.84%
S1 EUR H	0.75%	0.01%(13)	N/A	0.87%
SU	0.80%	0.01%(13)	N/A	0.90%

TABELLE 1

GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB SICAV I

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt-kostenquote*</u>
Arya European Alpha Portfolio				
Klasse				
F.....	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.33%
F CHF H	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.33%
F JPY	1.00%	0.01%(13)	N/A	1.33%
I	1.50%	0.05%	N/A	1.83%
S.....	N/A	0.01%(13)	N/A	0.33%
S GBP H	N/A	0.01%(13)	N/A	0.33%
SU	1.50%	0.01%(13)	N/A	1.83%
Z.....	N/A	N/A	N/A	0.01%
Z USD	N/A	N/A	N/A	0.01%

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

- (a) Die Anteilklasse wurde am 20. Mai 2021 aufgelöst.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 29. Januar 2021 aufgelöst.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 10. Mai 2021 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 6. November 2020 aufgelöst.
- (e) Die Anteilklasse wurde am 9. Dezember 2020 aufgelöst.
- (f) Die Anteilklasse wurde am 30. September 2020 aufgelöst.
- (g) Die Anteilklasse wurde am 25. Juni 2020 aufgelöst.
- (h) Die Anteilklasse wurde am 31. März 2021 aufgelöst.
- (i) Die Anteilklasse wurde am 23. Dezember 2020 aufgelöst.
- (j) Die Anteilklasse wurde am 11. Mai 2021 aufgelöst.

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%

TABELLE 2

PORTEFEUILLEUMSATZ

AB SICAV I

	Umsatz*
AB SICAV I–	
International Health Care Portfolio	-58.88%
International Technology Portfolio	-5.51%
Global Real Estate Securities Portfolio	17.07%
Sustainable Global Thematic Portfolio	-6.17%
India Growth Portfolio	58.91%
Euro High Yield Portfolio	75.75%
US Small and Mid-Cap Portfolio	2.01%
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	57.57%
RMB Income Plus Portfolio	27.89%
Short Duration High Yield Portfolio	-9.71%
Select US Equity Portfolio	220.12%
Global Plus Fixed Income Portfolio	218.83%
Select Absolute Alpha Portfolio	292.47%
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	126.97%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	-72.72%
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	139.52%
US High Yield Portfolio	65.38%
Low Volatility Equity Portfolio	6.24%
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	40.14%
Global Dynamic Bond Portfolio	211.47%
Concentrated US Equity Portfolio	3.03%
Concentrated Global Equity Portfolio	-34.97%
Global Core Equity Portfolio	76.13%
Global Income Portfolio	61.19%
Alternative Risk Premia Portfolio	361.79%
European Equity Portfolio	-9.74%
Eurozone Equity Portfolio	-48.78%
American Growth Portfolio	-86.65%
All Market Income Portfolio	35.67%
China A Shares Equity Portfolio	216.25%
Financial Credit Portfolio	287.98%
Low Volatility Total Return Equity Portfolio	110.92%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	180.50%
Event Driven Portfolio	306.09%
Arya European Alpha Portfolio	-229.46%

* 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 2021, 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 2021 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 den ISA, die für Luxemburg von der CSSF umgesetzt wurden, sind im Abschnitt „Pflichten des „Réviseur d'entreprises agréé“ bei der Abschlussprüfung“ in unserem Bericht näher beschrieben. Wir sind gemäß dem vom International Ethics Standards Board for Accountants herausgegebenen Code of Ethics for Professional Accountants, einschließlich der internationalen Unabhängigkeitsstandards, („IESBA-Kodex“) in der von der CSSF in Luxemburg umgesetzten Form in Verbindung mit den für unsere Prüfung des Abschlusses relevanten ethischen Anforderungen von dem Fonds unabhängig und sind unserer sonstigen ethischen Verantwortung gemäß diesen ethischen Anforderungen nachgekommen. 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 eines seiner 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. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den bis zum Datum unseres Berichts des „*réviseur d’entreprises agréé*“ erlangten Prüfungsnachweisen. Allerdings können zukünftige Ereignisse oder Bedingungen dazu führen, dass

der Fonds oder eines seiner Portefeuilles nicht mehr fortgeführt werden kann.

- 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 Personen 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 Maßnahmen zur Beseitigung von Bedrohungen der Schutzvorkehrungen.

Ernst & Young

Société anonyme

Cabinet de révision agréé

Kerry Nichol

Luxemburg, 10. September 2021

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 2021 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
- Sustainable Global Thematic Credit Portfolio
- Global Dynamic Bond Portfolio
- Global Income Portfolio
- Global Plus Fixed Income Portfolio
- Arya European Alpha Portfolio

AllianceBernstein Australia Limited:

- China A Shares Equity Portfolio
- Emerging Markets Low Volatility Equity 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 Luxembourg

UniCredit Bank Austria AG
Rothschildplatz 1
1020 Wien
Österreich

BNP Paribas Securities Services
Rue de Loxum 25
1000 Brüssel
Belgien

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

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

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

ODDO BHF Aktiengesellschaft
Bockenheimer Landstraße 10
60323 Frankfurt am Main
Deutschland

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

BNP Paribas Securities Services SA, 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 Estafeta nº 6 (La Moraleja)
Complejo Pza. de la Fuente- Edificio 3
28109, Alcobendas (Madrid)
Spanien

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

Proservice Finteco Spółka z o.o.
(Ehemals 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, Selnastrasse 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 Anteilhabern am Hauptsitz der Verwaltungsgesellschaft kostenlos zur Verfügung gestellt.

Richtlinie zu umstrittenen Waffen

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

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 2021 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
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	MSCI Emerging Markets	70.10%	103.33%	88.37%
All Market Income Portfolio	50% MSCI World Index / 40% Bloomberg Barclays Global High Yield (Hedged) / 10% Bloomberg Barclays Global Treasuries (Hedged)	60.71%	127.45%	93.36%

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	2.07%	20.00%	11.22%
RMB Income Plus Portfolio	1.59%	4.38%	2.89%
Short Duration High Yield Portfolio	1.96%	11.51%	6.64%
Global Plus Fixed Income Portfolio	1.68%	6.33%	4.60%
Select Absolute Alpha Portfolio	9.26%	23.49%	18.02%
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	4.94%	17.12%	13.05%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	2.55%	8.59%	6.45%
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	2.02%	17.25%	10.04%
US High Yield Portfolio	2.37%	16.96%	9.67%
Global Dynamic Bond Portfolio	1.15%	6.12%	4.15%
Global Income Portfolio	2.41%	12.30%	7.02%
Alternative Risk Premia Portfolio	4.09%	23.52%	8.13%
Low Volatility Total Return Equity Portfolio	2.78%	7.37%	4.92%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	2.89%	12.27%	7.63%
Event Driven Portfolio	8.63%	29.39%	12.84%
Arya European Alpha Portfolio	2.19%	17.12%	5.84%

Fremdfinanzierung

Für nachstehende Portefeuilles erwartet der Anlageverwalter, dass er keine Bankdarlehen benutzen wird, um die Anlagestrategie der 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:

- Euro High Yield Portfolio
20%-250% 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
- 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
- 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
- All Market Income Portfolio
0%-350% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Low Volatility Total Return Equity Portfolio
0%-200% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Sustainable Global Thematic Credit Portfolio
0%-200% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Event Driven Portfolio
200%-500% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles
- Arya European Alpha Portfolio
100%-400% des Nettoinventarwerts des Portefeuilles

Infolge der Verwendung des Summe-der-Nominalbeträge-Ansatzes betrug die durchschnittliche Fremdfinanzierung der Portefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021:

Portefeuille	Fremdfinanzierung
Euro High Yield Portfolio	29.39%
Emerging Markets Multi-Asset Portfolio	151.88%
RMB Income Plus Portfolio	83.79%
Short Duration High Yield Portfolio	45.54%
Global Plus Fixed Income Portfolio	114.82%
Select Absolute Alpha Portfolio	4.78%

Portefeuille	Fremd- finanzierung
Emerging Market Local Currency Debt Portfolio	197.84%
Asia Pacific Local Currency Debt Portfolio	109.33%
Emerging Market Corporate Debt Portfolio	23.22%
US High Yield Portfolio	44.21%
Global Dynamic Bond Portfolio	183.21%
Global Income Portfolio	110.45%
Alternative Risk Premia Portfolio	380.63%
All Market Income Portfolio	105.56%
Low Volatility Total Return Equity Portfolio	98.65%
Sustainable Global Thematic Credit Portfolio	87.93%
Event Driven Portfolio	226.58%
Arya European Alpha Portfolio	140.92%

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 2021:

Portefeuille	Fremd- finanzierung
International Health Care Portfolio	0.00%
International Technology Portfolio	0.00%
Global Real Estate Securities Portfolio	14.47%
Sustainable Global Thematic Portfolio	43.02%
India Growth Portfolio	0.99%
US Small and Mid-Cap Portfolio	0.00%
Select US Equity Portfolio	0.00%
Low Volatility Equity Portfolio	19.94%
Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio	0.00%
Concentrated US Equity Portfolio	0.00%
Concentrated Global Equity Portfolio	24.67%
Global Core Equity Portfolio	0.00%
European Equity Portfolio	20.57%
Eurozone Equity Portfolio	5.05%
American Growth Portfolio	0.00%
China A Shares Equity Portfolio	0.00%
Financial Credit Portfolio	62.03%

Vergütung

Vom 1. Januar 2020 bis zum 31. Dezember 2020 (der „Referenzzeitraum“) belief sich der Gesamtbetrag der Vergü-

tung, 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 89 Mitarbeitern bestand, einschließlich ihrer Zweigniederlassung) gezahlt wurde, auf EUR 14,050,887.15.

Insbesondere war der oben genannte Gesamtbetrag der im Referenzzeitraum gezahlten Vergütung folgendermaßen in eine feste und eine variable Vergütung unterteilt:

- Feste Vergütung: EUR 8,681,368.51

- Variable Vergütung: EUR 5,369,518.64

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 1,430,963.25 (wie folgt aufgeteilt: feste Vergütung EUR 1,108,931.46 variable Vergütung EUR 322,031.79, was weniger als 23% der Gesamtvergütung entspricht).

Die oben genannten Mitarbeiter setzen sich aus den folgenden Personengruppen zusammen: a) Mitglieder der Geschäftsleitung (während des Berichtszeitraums: drei), b) Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, deren Handlungen sich wesentlich auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft auswirken können oder die in die Vergütungsgruppe der leitenden Angestellten und Risikoträger fallen (während des Berichtszeitraums: vier) und c) Mitarbeiter mit Kontrollfunktionen (während des Berichtszeitraums: zwei).

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 perma-

nent 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 Körperschaftsteuer oder einer vergleichbaren Steuer unterliegen.

Im Geschäftsjahr zum 31. Mai 2021 investierte das folgende Portefeuille überwiegend in PEA-fähige aktienbezogene Wertpapiere. Der durchschnittliche tägliche Prozentsatz der Anlage in diesen Wertpapieren stellt sich wie folgt dar:

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 2021 hatte der Fonds Wertpapierleihgeschäfte, Total-Return-Swaps (TRS) und umgekehrte Pensionsgeschäfte abgeschlossen, die als Instrumententyp unter die SFT-Verordnung fallen.

Allgemeine Angaben

Zum 31. Mai 2021 belief sich das Vermögen über alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, Total-Return-Swaps und umgekehrten Pensionsgeschäfte hinweg auf folgende Beträge:

International Technology Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$23,942,429	1.61%	1.74%

Global Real Estate Securities Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$186,802	0.40%	0.42%

Sustainable Global Thematic Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$114,621,046	3.74%	4.18%

US Small and Mid-Cap Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$46,872	0.03%	0.03%

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$543,372	0.04%	0.06%

Select Absolute Alpha Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$6,289,903	0.69%	0.80%

Portefeuille	Täglicher Durchschnitt (%)
Eurozone Equity Portfolio	97.66%

Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$46,878,786	1.34%	1.40%

Global Core Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$45,570,306	2.63%	2.77%

Eurozone Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	€25,451,487	2.98%	3.10%

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	\$4,242,205	0.35%

Short Duration High Yield Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	\$30,011	0.00%

US High Yield Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	\$33,282	0.02%

Global Income Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	\$(69,991)	(0.07)%

Alternative Risk Premia Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	\$(58,443)	(0.10)%

All Market Income Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	\$326,676	0.02%

Event Driven Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Total-Return-Swaps	\$(1,151,900)	(0.70)%

Global Income Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NIW
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	\$3,142,813	2.98%

Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Während des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2021 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Es gab keine Wiederanlage von Barsicherheiten während des Geschäftsjahres zum 31. Mai 2021.

Angaben zur Konzentration

Zum 31. Mai 2021 waren Folgende die zehn größten Emittenten der bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, Total-Return-Swaps und umgekehrter Pensionsgeschäfte erhaltenen Sicherheitswertpapiere:

Wertpapierleihe**International Technology Portfolio**

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$16,096,576
2	Deutsche Regierung	\$10,904,466
3	Niederländische Regierung	\$1,557,183
4	Schwedische Regierung	\$69,535

Global Real Estate Securities Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$124,411
2	Deutsche Regierung	\$90,700
3	Niederländische Regierung	\$14,138

Sustainable Global Thematic Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$79,168,467
2	Deutsche Regierung	\$30,223,015
3	Niederländische Regierung	\$16,191,282
4	US-Regierung	\$1,646,160
5	Schwedische Regierung	\$1,491,443

US Small and Mid-Cap Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$28,126
2	Deutsche Regierung	\$26,848

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$483,834
2	Niederländische Regierung	\$96,949
3	Schwedische Regierung	\$13,672

Select Absolute Alpha Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$5,003,592
2	Deutsche Regierung	\$1,378,740
3	Niederländische Regierung	\$920,168
4	Schwedische Regierung	\$79,731

Low Volatility Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Deutsche Regierung	\$29,204,874
2	Französische Regierung	\$10,257,189
3	Regierung des Vereinigten Königreichs	\$9,785,667

Global Core Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$36,855,448
2	Deutsche Regierung	\$7,681,818
3	Niederländische Regierung	\$6,744,483
4	Schwedische Regierung	\$669,378
5	Regierung des Vereinigten Königreichs	\$629,836

Eurozone Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Regierung des Vereinigten Königreichs	€10,598,982
2	Französische Regierung	€8,994,221
3	Niederländische Regierung	€4,810,338
4	Deutsche Regierung	€2,320,656

Total-Return-Swaps

Zum 31. Mai 2021 wurden keine Wertpapiersicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Zum 31. Mai 2021 wurden keine Wertpapiersicherheiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhalten.

Zum 31. Mai 2021 waren Folgende die zehn größten Gegenparteien bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, Total-Return-Swaps und umgekehrter Pensionsgeschäfte:

International Technology Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$12,399,662
	2	UBS AG	\$8,779,146
	3	Citigroup Global Markets Limited	\$2,763,621

Global Real Estate Securities Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	UBS AG	\$116,646
	2	Merrill Lynch	\$70,156

Sustainable Global Thematic Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	\$59,276,297
	2	Merrill Lynch	\$36,290,071
	3	Credit Suisse	\$12,869,212
	4	UBS AG	\$6,185,466

US Small and Mid-Cap Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$46,872

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	\$543,372

Select Absolute Alpha Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	\$3,168,854
	2	UBS AG	\$2,927,028
	3	Merrill Lynch	\$194,021

Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Barclays	\$43,698,708
	2	Morgan Stanley	\$3,180,078

Global Core Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	\$26,603,949
	2	UBS AG	\$16,482,272
	3	Morgan Stanley	\$1,665,944
	4	Merrill Lynch	\$818,141

Eurozone Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Societe Generale	€25,451,487

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Goldman Sachs	\$4,242,205

Short Duration High Yield Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	JPMorgan Chase	\$30,011

US High Yield Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	JPMorgan Chase	\$33,282

Global Income Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Barclays	\$(69,991)

Alternative Risk Premia Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Goldman Sachs	\$150,218
	2	Barclays	\$80,895
	3	JPMorgan Chase	\$4,536
	4	Credit Suisse	\$(59,133)
	5	Bank of America	\$(107,301)
	6	Morgan Stanley	\$(127,658)

All Market Income Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Morgan Stanley	\$254,411
	2	Goldman Sachs	\$72,265

Event Driven Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Goldman Sachs	\$(7,767)
	2	Bank of America	\$(62,941)
	3	Credit Suisse	\$(350,067)
	4	Morgan Stanley	\$(731,125)

Global Income Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Umgekehrte Pensionsgeschäfte	1	JPMorgan Chase	\$3,142,813

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapierleihe

Zum 31. Mai 2021 hielten vier Depotbanken die folgenden erhaltenen Sicherheiten:

International Technology Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$17,566,470
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$11,061,290

Global Real Estate Securities Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$146,967
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$82,282

Sustainable Global Thematic Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$119,280,826
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$7,793,381
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$1,646,160

US Small and Mid-Cap Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$54,974

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$594,455

Select Absolute Alpha Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$3,694,320
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$3,687,911

Low Volatility Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$40,664,340
CREST	Wertpapiersicherheit	\$8,583,390

Global Core Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$31,814,114
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$20,766,849

Eurozone Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	€26,724,197

Total-Return-Swaps

Zum 31. Mai 2021 hielt eine Depotbank die folgenden erhaltenen Sicherheiten:

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag*
Brown Brothers Harriman	Barsicherheit	\$3,790,000

* Ein Teil der Sicherheit bezieht sich auf Derivate, die nicht unter die SFTR fallen.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Zum 31. Mai 2021 wurden keine Wertpapiersicherheiten für umgekehrte Pensionsgeschäfte erhalten.

Verwahrung der gewährten Sicherheiten*Total-Return-Swaps*

Zum 31. Mai 2021 beläuft sich der Anteil der Sicherheiten, der in separaten, gepoolten oder sonstigen Konten gehalten wird, auf Folgendes:

Alternative Risk Premia Portfolio

	%
Separate Konten	0%
Gepoolte Konten	0%
Sonstige	100%

Event Driven Portfolio

	%
Separate Konten	0%
Gepoolte Konten	0%
Sonstige	100%

*Umgekehrte Pensionsgeschäfte***Global Income Portfolio**

	%
Separate Konten	0%
Gepoolte Konten	0%
Sonstige	100%

Erträge/Kosten

Zum 31. Mai 2021 belaufen sich die Erträge und Kosten für alle Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften, Total-Return-Swaps und umgekehrten Pensionsgeschäften auf Folgendes:

*Wertpapierleihe***International Health Care Portfolio**

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$67,269	80%
Für dritte Partei	\$16,817	20%

International Technology Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$262,035	80%
Für dritte Partei	\$65,509	20%

Global Real Estate Securities Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$3,987	80%
Für dritte Partei	\$997	20%

Sustainable Global Thematic Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$41,350	80%
Für dritte Partei	\$10,338	20%

US Small and Mid-Cap Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$21	80%
Für dritte Partei	\$5	20%

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$2,684	80%
Für dritte Partei	\$671	20%

Select US Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$2,946	80%
Für dritte Partei	\$737	20%

Select Absolute Alpha Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$25,020	80%
Für dritte Partei	\$6,255	20%

Low Volatility Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$315,801	80%
Für dritte Partei	\$78,950	20%

Emerging Markets Low Volatility Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$904	80%
Für dritte Partei	\$226	20%

Concentrated US Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$392,838	80%
Für dritte Partei	\$98,210	20%

Concentrated Global Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$221,218	80%
Für dritte Partei	\$55,305	20%

Global Core Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$421,237	80%
Für dritte Partei	\$105,309	20%

Alternative Risk Premia Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$3,216	80%
Für dritte Partei	\$804	20%

European Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	€94,047	80%
Für dritte Partei	€23,512	20%

Eurozone Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	€322,356	80%
Für dritte Partei	€80,589	20%

Total-Return-Swaps

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$85,973,569	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$29,148,806	100%

Short Duration High Yield Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$14,580,897	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$14,789,299	100%

US High Yield Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$1,310,861	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$1,182,247	100%

Global Income Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$12,504	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$189,828	100%

Alternative Risk Premia Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$5,905,963	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$5,879,901	100%

All Market Income Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$6,572,620	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$14,337,255	100%

Event Driven Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$27,750,696	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$31,098,866	100%

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Global Income Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$0	100%
Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$1,337	100%

* Die Erträge (Kosten) werden während des Berichtszeitraums als realisierte Gewinne (Verluste), Veränderung 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 2021 besitzen die verschiedenen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, Total-Return-Swaps und umgekehrten Pensionsgeschäfte 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	\$23,942,429

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	\$186,802

Sustainable Global Thematic 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	\$114,621,046

US Small and Mid-Cap 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	\$46,872

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	\$543,372

Select Absolute Alpha 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	\$6,289,903

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	\$46,878,786

Global Core 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	\$45,570,306

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	€25,451,487

*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	\$4,242,205
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	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$30,011
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	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$33,282
Über ein Jahr	\$0
Offene Fälligkeit	\$0

Global Income Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$(69,991)
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
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	\$23,714
Ein bis drei Monate	\$(205,909)
Drei Monate bis ein Jahr	\$103,349
Über ein Jahr	\$20,403
Offene Fälligkeit	\$0

All Market Income Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$326,676
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Über ein Jahr	\$0
Offene Fälligkeit	\$0

Event Driven Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$(731,125)
Drei Monate bis ein Jahr	\$(413,008)
Über ein Jahr	\$(7,767)
Offene Fälligkeit	\$0

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Global Income 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	\$3,142,813

Zum 31. Mai 2021 kommen folgende Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, Total-Return-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte zum Einsatz:

Wertpapierleihe

International Technology Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$23,942,429

Global Real Estate Securities Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$186,802

Sustainable Global Thematic Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$114,621,046

US Small and Mid-Cap Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$46,872

Emerging Markets Multi-Asset Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$543,372

Select Absolute Alpha Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$6,289,903

Low Volatility Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$46,878,786

Global Core Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$45,570,306

Eurozone Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	€25,451,487

*Total-Return-Swaps***Emerging Markets Multi-Asset Portfolio**

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$4,242,205

Short Duration High Yield Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$30,011

US High Yield Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$33,282

Global Income Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$(69,991)

Alternative Risk Premia Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$(58,443)

All Market Income Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$326,676

Event Driven Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$(1,151,900)

*Umgekehrte Pensionsgeschäfte***Global Income Portfolio**

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$3,142,813

Die zusammenfassenden Transaktionsangaben für Sicherheitenpositionen (einschließlich Barmittel), die zum 31. Mai 2021 für sämtliche Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, Total-Return-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte erhalten wurden, lauten folgendermaßen:

Wertpapierleihe
International Technology Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$2,617,745	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2024	\$2,617,733	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.50%, 05/25/2030	\$2,617,644	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$2,205,165	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$2,006,468	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.75%, 10/25/2027	\$1,977,703	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 01/04/2024	\$1,629,064	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$1,613,418	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$1,577,462	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/14/2023	\$1,562,856	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2022	\$1,184,890	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$1,064,094	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 02/15/2028	\$988,027	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 08/25/2021	\$544,218	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/26/2022	\$544,213	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$544,211	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/28/2021	\$544,184	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 07/25/2024	\$508,126	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 06/29/2021	\$493,089	AAA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$479,194	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2030	\$436,234	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 02/25/2022	\$283,981	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	\$282,950	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/07/2021	\$235,556	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$69,535	AAA	>1 Jahr	SEK	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
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.75%, 10/25/2027	\$26,277	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 01/04/2024	\$21,645	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$21,437	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$20,959	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2022	\$15,743	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$14,811	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2024	\$14,811	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.50%, 05/25/2030	\$14,810	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$14,138	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 02/15/2028	\$13,128	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$12,477	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$11,352	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/14/2023	\$8,842	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 07/25/2024	\$6,751	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	\$3,759	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/07/2021	\$3,130	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$2,711	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2030	\$2,468	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Sustainable Global Thematic Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 08/25/2021	\$11,672,800	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/26/2022	\$11,672,707	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$11,672,667	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/28/2021	\$11,672,084	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 06/29/2021	\$10,576,164	AAA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$7,661,350	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2024	\$7,661,315	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.50%, 05/25/2030	\$7,661,053	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$6,453,854	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 02/25/2022	\$6,091,039	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$5,872,325	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/14/2023	\$4,574,007	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Credit Suisse	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2024	\$2,432,699	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 01/15/2022	\$2,432,697	AAA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 02/15/2026	\$2,432,689	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Deutsche Staatsanleihe 2.00%, 08/15/2023	\$2,381,914	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2030	\$1,942,815	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 12/31/2023	\$1,646,052	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$1,491,443	AAA	>1 Jahr	SEK	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$1,402,457	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.75%, 10/25/2027	\$1,393,417	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2030	\$1,276,725	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 01/04/2024	\$1,147,779	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$1,136,756	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$1,111,422	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2022	\$834,830	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$749,722	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 02/15/2028	\$696,128	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 07/25/2024	\$358,007	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Französische Staatsanleihe 0.25%, 11/25/2026	\$245,991	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	\$199,356	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/07/2021	\$165,964	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
Credit Suisse	US-amerikanische Schatzanweisung 2.63%, 02/15/2029	\$108	AA+	>1 Jahr	\$	Schweiz

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Credit Suisse	Deutsche Staatsanleihe 5.63%, 01/04/2028	\$19	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$12	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

US Small and Mid-Cap Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$9,895	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2024	\$9,895	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.50%, 05/25/2030	\$9,895	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$8,336	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$7,585	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/14/2023	\$5,908	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$1,811	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2030	\$1,649	AAA	>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
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 08/25/2021	\$107,002	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$107,001	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/26/2022	\$107,001	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/28/2021	\$106,995	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 06/29/2021	\$96,949	AAA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 02/25/2022	\$55,835	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$13,672	AAA	>1 Jahr	SEK	Vereinigte Staaten

Select Absolute Alpha Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.75%, 10/25/2027	\$659,380	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 08/25/2021	\$624,017	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/26/2022	\$624,012	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$624,010	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/28/2021	\$623,978	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 06/29/2021	\$565,392	AAA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 01/04/2024	\$543,141	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$537,925	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$525,937	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2022	\$395,050	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$354,776	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 02/15/2028	\$329,415	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 02/25/2022	\$325,621	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 07/25/2024	\$169,413	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	\$94,338	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$79,731	AAA	>1 Jahr	SEK	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/07/2021	\$78,536	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$40,961	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2024	\$40,960	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.50%, 05/25/2030	\$40,959	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$34,505	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$31,396	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/14/2023	\$24,454	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$7,498	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2030	\$6,826	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
Barclays	Französische Staatsanleihe 3.50%, 04/25/2026	\$8,263,386	AA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.75%, 07/22/2023	\$7,800,671	AA	>1 Jahr	£	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2031	\$7,378,847	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2027	\$6,047,623	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2028	\$5,802,930	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 01/04/2025	\$5,455,350	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/10/2025	\$4,376,543	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.50%, 07/22/2022	\$782,719	AA	>1 Jahr	£	Großbritannien
Morgan Stanley & Co. International PLC	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 08/10/2028	\$601,139	AA	>1 Jahr	£	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 2.25%, 10/25/2022	\$601,138	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 0.25%, 11/25/2026	\$601,138	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 03/22/2029	\$601,138	AA	>1 Jahr	£	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$601,074	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 3.50%, 04/25/2026	\$169,437	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	\$143,581	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$21,016	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Global Core Equity Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 08/25/2021	\$5,238,900	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 01/26/2022	\$5,238,858	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$5,238,840	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/28/2021	\$5,238,578	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Schatzanweisungen 0.00%, 06/29/2021	\$4,746,716	AAA	1 Monat bis 3 Monate	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 2.75%, 10/25/2027	\$3,713,007	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 01/04/2024	\$3,058,462	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$3,029,087	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$2,961,582	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 0.00%, 02/25/2022	\$2,733,735	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 07/04/2022	\$2,224,553	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$1,997,767	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 02/15/2028	\$1,854,956	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 07/25/2024	\$953,974	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$669,378	AAA	>1 Jahr	SEK	Vereinigte Staaten
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2026	\$531,220	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 07/07/2021	\$442,241	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 2.25%, 10/25/2022	\$314,918	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 0.25%, 11/25/2026	\$314,918	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 08/10/2028	\$314,918	AA	>1 Jahr	£	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 03/22/2029	\$314,918	AA	>1 Jahr	£	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$314,884	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$172,721	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2024	\$172,720	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 2.50%, 05/25/2030	\$172,714	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$145,499	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2026	\$132,389	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 04/14/2023	\$103,119	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 3.50%, 04/25/2026	\$88,763	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 11/15/2027	\$75,218	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 08/15/2030	\$31,618	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2030	\$28,783	AAA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley & Co. International PLC	Französische Staatsanleihe 0.50%, 05/25/2025	\$11,009	AA	>1 Jahr	€	Vereinigte Staaten

* 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	Niederländische Staatsanleihe 0.25%, 07/15/2029	€4,810,338	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französischer Schatzwechsel 0.00%, 08/25/2021	€4,810,323	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 2.75%, 10/25/2027	€4,183,898	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.75%, 09/07/2022	€3,863,754	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.38%, 10/22/2030	€3,788,406	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Britische Staatsanleihe (Gilt) 1.50%, 07/22/2026	€2,946,822	AA	>1 Jahr	£	Frankreich
Societe Generale	Deutsche Staatsanleihe 5.50%, 01/04/2031	€2,110,747	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Deutsche Staatsanleihe 1.50%, 05/15/2024	€209,909	AAA	>1 Jahr	€	Frankreich

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

*Total-Return-Swaps***Emerging Markets Multi-Asset Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag*	Qualität**	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Goldman Sachs	Barmittel	\$3,790,000	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.

Die zusammenfassenden Transaktionsangaben für Sicherheitenpositionen (einschließlich Barmittel), die zum 31. Mai 2021 für sämtliche Wertpapierfinanzierungsgeschäfte, Total-Return-Swaps und umgekehrte Pensionsgeschäfte gewährt wurden, lauten folgendermaßen:

*Total-Return-Swaps***Alternative Risk Premia Portfolio**

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag*	Qualität**	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Morgan Stanley	Barmittel	\$2,800,800	N/A	N/A	\$	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	Barmittel	\$1,073,300	N/A	N/A	\$	Vereinigte Staaten
Bank of America	Barmittel	\$425,000	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
Morgan Stanley	US-Schatzanweisung, 0.88%, 11/15/2030	\$1,899,578	AA+	>1 Jahr	\$	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	US-Schatzanweisung, 0.63%, 08/15/2030	\$1,063,222	AA+	>1 Jahr	\$	Vereinigte Staaten
Goldman Sachs	US-Schatzanweisung, 0.63%, 08/15/2030	\$624,027	AA+	>1 Jahr	\$	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Barmittel	\$323,000	N/A	N/A	\$	Vereinigte Staaten
Goldman Sachs	Barmittel	\$21,000	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.

Event Driven Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag*	Qualität**	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Goldman Sachs	Barmittel	\$22,156,735	N/A	N/A	\$	Vereinigte Staaten
Morgan Stanley	Barmittel	\$16,790,086	N/A	N/A	\$	Vereinigte Staaten
Goldman Sachs	US-Schatzwechsel, 0.00%, 10/21/2021	\$1,642,970	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	Vereinigte Staaten
Bank of America	Barmittel	\$348,000	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.

Umgekehrte Pensionsgeschäfte

Global Income Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
JPMorgan Chase	US-Schatzanleihen, 6.50%, 11/15/2026	\$1,167,187	AA+	>1 Jahr	\$	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	US-Schatzanleihen, 6.50%, 11/15/2026	\$972,656	AA+	>1 Jahr	\$	Vereinigte Staaten
JPMorgan Chase	US-Schatzanleihen, 6.50%, 11/15/2026	\$907,813	AA+	>1 Jahr	\$	Vereinigte Staaten

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT	AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. 2-4, rue Eugène Ruppert L-2453 Luxembourg RCS: B34405
VERWALTUNGSRAT DES FONDS	Bertrand Reimmel Silvio Cruz Scott Parkin Olivia Moessner Susanne van Dootin
VERWALTUNGSRAT DER VERWALTUNGSGESELLSCHAFT	Bertrand Reimmel Silvio Cruz Yves Prussen Steven Eisenberg Mark Manley
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 Luxembourg
REGISTER- UND TRANSFERSTELLE	AllianceBernstein Investor Services ein Geschäftsbereich von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. 2-4, rue Eugène Ruppert L-2453 Luxembourg
VERTRIEBSSTELLE	AllianceBernstein Investments ein Geschäftsbereich von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. 2-4, rue Eugène Ruppert L-2453 Luxembourg
UNABHÄNGIGER WIRTSCHAFTSPRÜFER	Ernst & Young S.A. 35E Avenue John F. Kennedy L-1855 Luxembourg

* 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.)

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)



ALLIANCEBERNSTEIN®

ASCV-SRA-GR-SZ-0521