



ALLIANCEBERNSTEIN®

JAHRESBERICHT

AB FCP I

Bestimmte Portefeuilles des Fonds sind zum Angebot an nicht qualifizierte Anleger in der Schweiz nicht zugelassen. Daher 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.

Multi-Asset/Asset Allocation

+ DYNAMIC DIVERSIFIED PORTFOLIO

Equity

+ GLOBAL EQUITY BLEND PORTFOLIO

+ GLOBAL VALUE PORTFOLIO

+ EMERGING MARKETS GROWTH
PORTFOLIO

+ SUSTAINABLE US THEMATIC
PORTFOLIO

+ ASIA EX-JAPAN EQUITY PORTFOLIO

+ JAPAN STRATEGIC VALUE PORTFOLIO

+ CHINA LOW VOLATILITY EQUITY
PORTFOLIO

Fixed Income

+ SHORT DURATION BOND PORTFOLIO

+ GLOBAL HIGH YIELD PORTFOLIO

+ AMERICAN INCOME PORTFOLIO

+ EUROPEAN INCOME PORTFOLIO

+ EMERGING MARKETS DEBT PORTFOLIO

+ MORTGAGE INCOME PORTFOLIO

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

RCS: K217

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.

	Seite
Brief an die Anteilhaber	1
Wertentwicklung der Anteile	2
Verzeichnis der Anlagewerte	14
Zusammensetzung des Fondsvermögens	146
Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens	150
Umlaufende Anteile	154
Statistische Informationen	162
Anmerkungen zum Jahresabschluss	179
Tabelle 1 – Gebührenstruktur	202
Tabelle 2 – Portefeuilleumsatz	217
Bericht des unabhängigen Wirtschaftsprüfers	218
Informationen für die Anteilhaber (ungeprüft)	220

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

23. September 2021

Sehr geehrte Anteilhaber,

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

Globale Aktien verzeichneten im Zwölfmonatszeitraum zum 31. August 2021 hohe zweistellige Renditen, da die weiterhin expansive Geldpolitik, das hohe Tempo der Impfungen und das starke Gewinnwachstum der Unternehmen die Aktienmärkte unterstützten. Die Volatilität nahm in der Mitte des Zeitraums zu, als die rasche wirtschaftliche Erholung Inflationsängste auslöste und zu einer zeitweiligen Stilrotation führte, bei der wachstums- und wertorientierte Aktien abwechselnd die Führung übernahmen. Die weltweite Geldpolitik blieb moderat, und die Märkte beruhigten sich, nachdem die US-Notenbank (die „Fed“) und die wichtigsten Zentralbanken den vorübergehenden Charakter der derzeit höheren Inflation und ihre Entschlossenheit, die Unterstützung nicht vorzeitig zurückzunehmen, betont hatten.

Am Ende des Berichtszeitraums schwankte die Marktstimmung aufgrund der rapide ansteigenden Zahl von Fällen der Delta-Variante des Coronavirus und der Angst vor einer plötzlichen Drosselung der Wertpapierkäufe durch die Fed. Die globalen Märkte waren beruhigt, nachdem der Vorsitzende der US-Notenbank Jerome Powell frühere Kommentare zum möglichen Zeitpunkt der Drosselung und Zinserhöhungen bestätigt hatte. Small-Cap-Aktien schnitten relativ gesehen deutlich besser ab als Large-Cap-Aktien, und trotz der zeitweiligen Marktrotation

schnitten wertorientierte Aktien besser ab als ihre wachstumsorientierten Pendanten.

Die Renditen an den Rentenmärkten waren uneinheitlich, da die Renditen längerfristiger Staatsanleihen je nach Region unterschiedlich ausfielen: Staatsanleihen in Kanada, den USA und dem Vereinigten Königreich gaben nach, während Staatsanleihen in der Eurozone, Japan und Australien zulegten. Die niedrigen Zinssätze bildeten auch die Grundlage für einen kräftigen Aufschwung bei Risikoanlagen. Hochverzinsliche Unternehmensanleihen aus Schwellenländern und Industrieländern sowie hochverzinsliche Staatsanleihen aus Schwellenländern legten deutlich zu, da die Anleger nach höheren Renditen suchten. Investment-Grade-Unternehmensanleihen aus Schwellenländern und Industrieländern verbuchten ebenfalls ein Plus. Investment-Grade-Anleihen in der Eurozone schnitten besser ab als US-Anleihen, da die Renditen in der Eurozone im Gleichklang mit den Renditen von Staatsanleihen fielen. Anleihen von Schwellenländern in lokaler Währung legten zu, da der US-Dollar gegenüber den meisten Währungen von Industrieländern und Schwellenländern fiel. Verbriefte Vermögenswerte schnitten besser ab als US-Staatsanleihen, insbesondere bei den durch gewerbliche Hypotheken besicherten Wertpapieren. Die Preise für Rohöl der Sorte Brent und Kupfer stiegen stark an, da sich die Weltwirtschaft weiter von der Pandemie erholte.

Wir danken Ihnen für Ihre Anlage in den Fonds.

Mit freundlichen Grüßen

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

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
<u>Dynamic Diversified Portfolio</u>				
Klasse				
A	10.14%	18.95%	4.68%	61.53%
A EUR(a)	12.56%	20.21%	–	97.31%
A EUR H	9.61%	17.57%	1.86%	41.40%
AX	10.19%	19.03%	4.74%	94.73%
AX EUR(a)	12.61%	20.22%	–	109.58%
AX SGD(a)	11.21%	17.59%	–	52.27%
BX	9.63%	17.78%	3.76%	64.73%
BX SGD(a)	10.75%	16.45%	–	29.51%
C	9.97%	18.58%	4.40%	57.40%
C EUR(a)	12.42%	19.83%	–	92.31%
C EUR H	9.42%	17.17%	1.61%	37.87%
CX	10.01%	18.61%	4.48%	86.07%
I	10.56%	19.78%	5.47%	72.40%
I EUR(a)	13.00%	21.00%	–	110.58%
I EUR H	9.96%	18.36%	2.63%	50.87%
IX	10.59%	19.83%	5.51%	117.13%
S1 EUR H	10.23%	18.90%	3.02%	59.40%
<u>Global Equity Blend Portfolio</u>				
Klasse				
A	15.11%	34.67%	16.25%	194.80%
A EUR(a)	17.67%	36.08%	–	194.11%
A EUR H	14.53%	33.00%	12.55%	76.53%
A SGD(a)	16.20%	33.08%	–	90.63%
B	14.56%	33.35%	15.15%	146.30%
B SGD(a)	15.63%	31.77%	–	62.37%
C	14.88%	34.11%	15.70%	129.19%
C EUR(a)	17.46%	35.59%	–	146.87%
I	15.60%	35.78%	17.19%	241.50%
I EUR(a)	18.18%	37.19%	–	240.64%
S HKD(a)	16.53%	37.70%	–	211.84%
S1	15.80%	36.26%	17.78%	227.94%
S1 EUR(a)	18.35%	37.70%	–	245.54%
S1 GBP(a)	17.41%	32.45%	–	292.72%
S1 SGD(a)	16.91%	34.64%	–	127.28%
<u>Global Value Portfolio</u>				
Klasse				
A	13.98%	33.86%	3.32%	121.00%
A EUR(a)	16.56%	35.26%	–	67.29%
A SGD(a)	15.05%	32.30%	–	14.56%
A SGD H	13.87%	33.39%	1.76%	48.87%
AD	13.96%	33.96%	3.32%	53.12%
AD AUD H	13.75%	32.30%	-1.93%	48.44%
AD CAD H	13.66%	32.80%	0.38%	43.69%
AD EUR H	13.36%	32.18%	0.34%	36.44%
AD GBP H	13.56%	32.52%	-0.16%	39.23%
AD HKD(a)	14.27%	34.43%	–	54.41%
AD SGD H	13.94%	33.52%	1.68%	48.83%
AD ZAR H	16.44%	39.20%	4.15%	109.69%
B	13.43%	32.58%	2.33%	80.70%
BD	13.45%	32.60%	2.31%	44.03%
C	13.66%	33.29%	2.82%	109.67%
C EUR(a)	16.23%	34.63%	–	107.20%
I	14.45%	34.97%	4.14%	158.20%
I EUR(a)	16.96%	36.37%	–	87.48%
I SGD(a)	15.53%	33.36%	–	28.86%
S	14.96%	36.20%	5.17%	100.46%
S GBP(a)	16.66%	32.47%	–	166.55%
S GBP H	14.57%	34.87%	1.62%	57.80%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global Value Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S1	14.55%	35.26%	4.42%	119.21%
S1 EUR(a)	17.11%	36.66%	–	148.92%
S1 GBP(a)	16.17%	31.47%	–	212.66%
SD	14.97%	36.22%	5.14%	76.62%
Emerging Markets Growth Portfolio				
Klasse				
A	-5.43%	16.77%	18.66%	458.50%
A AUD H	-5.80%	15.32%	13.43%	63.60%
A EUR(a)	-3.35%	17.96%	–	187.65%
A HKD(a)	-5.17%	17.19%	–	65.54%
A PLN H	-6.00%	15.02%	15.88%	24.64%
A SGD(a)	-4.54%	15.39%	–	76.49%
A SGD H	-5.55%	16.28%	17.06%	27.13%
AD	-5.43%	16.73%	18.64%	55.72%
B	-5.90%	15.61%	17.47%	321.40%
C	-5.65%	16.25%	18.11%	193.92%
C AUD H	-6.06%	14.75%	12.90%	54.00%
C EUR(a)	-3.55%	17.48%	–	155.15%
ED	-5.90%	15.60%	17.47%	10.80%
I	-5.05%	17.71%	19.60%	281.90%
I AUD H	-5.42%	16.26%	14.33%	76.87%
I EUR(a)	-2.94%	18.94%	–	239.87%
N	-5.63%	16.28%	18.13%	83.33%
S	-4.53%	18.98%	20.97%	149.76%
S1	-4.96%	17.92%	19.85%	245.50%
S1 EUR(a)	-2.84%	19.14%	–	278.68%
S1 GBP(a)	-3.60%	14.67%	–	364.68%
Sustainable US Thematic Portfolio				
Klasse				
A	18.46%	34.38%	30.14%	347.90%
A AUD H	18.33%	33.54%	24.63%	418.94%
A CAD H	18.32%	33.79%	27.84%	378.80%
A EUR(a)	21.13%	35.79%	–	239.05%
A EUR H	17.95%	32.84%	27.03%	366.54%
A GBP H	18.33%	33.87%	26.49%	290.74%
A HKD(a)	18.82%	34.89%	–	433.11%
A SGD H	18.44%	34.07%	28.63%	286.67%
AN	18.48%	34.38%	30.14%	475.60%
B	17.90%	33.08%	28.83%	266.90%
C	18.20%	33.75%	29.58%	324.80%
C EUR(a)	20.82%	35.16%	–	209.11%
C EUR H	17.70%	32.27%	26.44%	347.34%
C SGD(a)	19.35%	32.18%	–	213.26%
E	11.60%(1)	–	–	11.60%
I	18.96%	35.47%	31.17%	429.00%
I EUR(a)	21.61%	36.88%	–	297.87%
I EUR H	18.45%	33.92%	27.99%	406.67%
I GBP	20.58%	31.78%	25.67%	65.60%
IN	18.96%	35.45%	31.17%	529.34%
IN EUR(a)	21.61%	36.87%	–	552.12%
S	19.47%	36.60%	32.31%	380.27%
S1	19.07%	35.72%	31.45%	412.58%
S1 EUR(a)	21.71%	37.13%	–	427.57%
S1 JPY H	18.99%	35.06%	29.63%	420.00%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Asia Ex-Japan Equity Portfolio				
Klasse				
A	1.66%	32.23%	7.91%	84.07%
A AUD H	1.17%	30.35%	3.71%	84.67%
A EUR(a)	3.91%	33.60%	–	134.03%
A HKD(a)	1.94%	32.70%	–	84.72%
A SGD H	1.43%	31.52%	6.41%	32.40%
AD	1.69%	32.29%	7.83%	84.18%
AD AUD H	1.16%	30.38%	3.75%	85.06%
AD CAD H	1.30%	31.11%	5.61%	31.81%
AD EUR(a)	3.90%	33.66%	–	134.12%
AD EUR H	0.98%	30.32%	4.86%	34.61%
AD GBP H	1.29%	30.89%	4.96%	48.64%
AD HKD(a)	1.96%	32.75%	–	84.82%
AD NZD H	1.13%	30.89%	4.79%	73.96%
AD RMB H	2.99%	34.60%	8.45%	78.90%
AD SGD H	1.47%	31.58%	6.46%	42.63%
AD ZAR H	3.54%	36.93%	10.75%	140.09%
AY JPY	4.91%	37.36%	7.58%	118.84%
BD	1.15%	30.90%	6.82%	63.66%
BD AUD H	0.66%	29.07%	2.67%	66.37%
BD CAD H	0.86%	29.89%	4.51%	23.89%
BD HKD(a)	1.46%	31.40%	–	64.30%
BD NZD H	0.63%	29.65%	3.64%	59.04%
BD ZAR H	3.15%	35.79%	9.68%	89.10%
BY JPY	4.67%	36.73%	7.07%	109.01%
C	1.43%	31.61%	7.51%	74.60%
C AUD H	0.94%	29.84%	3.25%	79.00%
C EUR(a)	3.65%	32.91%	–	121.92%
ED	1.14%	30.91%	6.74%	10.83%
I	2.05%	33.30%	8.74%	102.27%
I AUD H	1.58%	31.40%	4.58%	105.87%
I EUR(a)	4.34%	34.70%	–	157.26%
I GBP	3.42%	29.65%	-0.98%	65.27%
ID	2.05%	33.28%	8.77%	102.43%
ID AUD H	1.55%	31.36%	4.58%	105.72%
S	2.62%	34.74%	9.97%	129.87%
S HKD(a)	2.92%	35.24%	–	100.61%
S1	2.14%	33.56%	8.98%	106.40%
S1 EUR(a)	4.42%	34.95%	–	162.46%
SD	2.61%	34.75%	9.97%	86.69%

Japan Strategic Value Portfolio

Klasse				
A	5.18%	22.36%	1.09%	16.76%
A AUD H	4.75%	21.31%	-1.00%	51.40%
A CZK H	4.98%	21.36%	0.24%	-4.74%
A EUR(a)	4.21%	19.12%	–	25.20%
A EUR H	4.67%	21.13%	-0.36%	80.80%
A NZD H	5.03%	21.87%	0.10%	65.67%
A PLN(a)(b)	-1.35%	–	–	8.70%
A SGD(a)	2.79%	16.31%	–	3.67%
A SGD H	5.09%	22.31%	0.81%	11.47%
A USD(a)	1.90%	17.90%	–	23.59%
A USD H	5.15%	22.52%	1.70%	120.53%
AD	5.15%	22.32%	1.09%	44.79%
AD AUD H	4.77%	21.29%	-1.03%	47.29%
AD NZD H	5.02%	21.85%	0.03%	55.90%
AD USD H	5.12%	22.50%	1.72%	39.40%
AD ZAR H	7.17%	27.68%	4.24%	112.47%
BD AUD H	4.24%	20.10%	-1.98%	36.12%
C	4.85%	21.69%	0.64%	9.54%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Japan Strategic Value Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
C EUR(a)	3.94%	18.52%	–	25.84%
C EUR H	4.42%	20.61%	-0.75%	70.07%
C USD(a)	1.62%	17.29%	–	16.09%
I	5.52%	23.26%	1.95%	32.44%
I EUR(a)	4.60%	20.03%	–	52.12%
I EUR H	5.10%	22.12%	0.50%	97.67%
I SGD(a)	3.16%	17.21%	–	16.72%
I USD(a)	2.26%	18.80%	–	40.35%
I USD H	5.55%	23.47%	2.51%	138.47%
S EUR H	5.72%	23.60%	1.62%	95.87%
S1 EUR(a)	4.88%	20.65%	–	49.61%
S1 USD(a)	2.54%	19.41%	–	47.68%
S1 USD H	5.87%	24.18%	3.03%	71.87%
SD	6.23%	24.80%	3.07%	72.45%

China Low Volatility Equity Portfolio

Klasse				
A	-14.23%	-4.08%	26.70%	544.10%
A EUR(a)	-12.33%	-3.09%	–	231.55%
A HKD(a)	-13.98%	-3.73%	–	60.97%
A PLN H	-14.76%	-5.05%	24.65%	7.36%
AD	-14.23%	-4.05%	26.64%	69.48%
AD AUD H	-14.69%	-4.96%	22.77%	61.17%
AD CAD H	-14.47%	-4.60%	24.74%	56.78%
AD EUR H	-14.81%	-5.21%	23.62%	47.68%
AD GBP H	-14.50%	-4.62%	23.89%	53.86%
AD HKD(a)	-13.99%	-3.71%	–	71.55%
AD NZD H	-14.72%	-4.83%	23.58%	68.01%
AD RMB H	-13.10%	-2.21%	27.25%	89.17%
AD SGD H	-14.35%	-4.32%	25.33%	59.48%
AD ZAR H	-12.72%	-0.41%	31.05%	126.94%
B	-14.65%	-5.01%	25.43%	407.40%
B EUR(a)	-12.75%	-4.02%	–	179.39%
BD NZD H	-15.11%	-5.71%	22.85%	56.53%
BD ZAR H	-13.12%	-1.45%	29.79%	107.04%
C	-14.41%	-4.51%	26.13%	47.64%
C EUR(a)	-12.52%	-3.51%	–	62.69%
I	-13.88%	-3.31%	27.71%	676.70%
I EUR(a)	-11.97%	-2.30%	–	280.01%
S	-13.43%	-2.31%	29.49%	233.94%
S1	-13.77%	-3.05%	28.38%	184.74%
S1 EUR(a)	-11.84%	-2.02%	–	235.29%

Short Duration Bond Portfolio

Klasse				
A	0.25%	0.11%	1.02%	119.61%
A EUR(a)	2.44%	1.24%	–	17.35%
A2	0.22%	0.05%	1.04%	76.89%
A2 EUR(a)	2.49%	1.10%	–	16.99%
A2 EUR H	-0.21%	-0.82%	-0.95%	-3.47%
A2 HKD(a)	0.54%	0.45%	–	33.94%
A2 SGD H	0.26%	0.06%	0.65%	3.93%
AA	0.20%	0.05%	1.05%	3.85%
AA AUD H	0.00%	-0.34%	0.22%	7.88%
AA CAD H	0.12%	-0.10%	0.59%	1.69%
AA GBP H	0.03%	-0.28%	-0.06%	-1.96%
AA HKD(a)	0.52%	0.47%	–	4.19%
AA NZD H	0.14%	-0.07%	0.47%	10.68%
AA SGD H	0.20%	-0.03%	0.62%	2.35%
AJ	0.35%	0.29%	1.23%	95.75%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AR EUR H	-0.22%	-0.79%	-0.92%	-7.26%
AT	0.25%	-0.02%	1.15%	59.15%
AT AUD H	0.00%	-0.34%	0.18%	24.90%
AT CAD H	0.18%	-0.06%	0.61%	7.78%
AT EUR(a)	2.45%	1.09%	–	53.37%
AT EUR H	-0.29%	-0.91%	-0.90%	-4.36%
AT GBP H	0.10%	-0.21%	0.06%	1.13%
AT HKD(a)	0.55%	0.37%	–	33.84%
AT NZD H	0.20%	-0.02%	0.49%	13.80%
AT SGD H	0.21%	0.01%	0.61%	1.42%
AX	0.31%	0.13%	1.27%	186.99%
B	-0.26%	-0.90%	0.01%	70.76%
B2 EUR(a)	1.92%	0.08%	–	-4.47%
BT	-0.39%	-1.02%	0.14%	26.34%
C	0.03%	-0.34%	0.57%	57.68%
C2	0.07%	-0.33%	0.66%	53.79%
C2 EUR H	-0.43%	-1.22%	-1.28%	-8.40%
I	0.54%	0.55%	1.71%	146.37%
I EUR(a)	2.73%	1.66%	–	31.87%
I2	0.53%	0.60%	1.77%	44.11%
I2 AUD H	0.45%	0.35%	0.76%	33.80%
I2 EUR(a)	2.73%	1.62%	–	55.94%
I2 EUR H	0.13%	-0.19%	-0.26%	2.73%
IT	0.50%	0.59%	1.69%	7.66%
IT AUD H	0.42%	0.35%	0.65%	14.44%
N2	0.00%	-0.41%	0.54%	-1.80%
NT	-0.08%	-0.49%	0.63%	-1.94%
S	0.75%	1.08%	–	3.37%
S EUR H	0.36%	0.24%	0.18%	10.13%
S SGD H	0.78%	1.12%	1.72%	19.93%
S1 2	0.66%	0.84%	1.95%	12.53%
S1 2 EUR(a)	2.88%	1.85%	–	18.98%
S1 EUR H	0.26%	0.00%	0.00%	4.40%
SA	0.79%	1.14%	2.17%	14.27%

Global High Yield Portfolio

Klasse				
A	3.62%	10.64%	-0.93%	261.28%
A EUR(a)	5.61%	11.68%	–	175.97%
A2	3.74%	10.63%	-0.94%	294.58%
A2 CHF H	3.10%	9.19%	-3.85%	10.87%
A2 EUR(a)	6.02%	11.78%	–	194.82%
A2 EUR H	3.29%	9.52%	-3.74%	67.27%
A2 HKD(a)	4.06%	11.06%	–	211.48%
A2 PLN H	3.51%	9.94%	-2.99%	8.67%
A2 SGD(a)	4.72%	9.29%	–	70.44%
A2 SGD H	3.74%	10.49%	-2.09%	51.67%
AA	3.71%	10.53%	-0.95%	32.38%
AA AUD H	3.59%	10.08%	-4.35%	32.36%
AA CAD H	3.60%	10.29%	-2.83%	21.88%
AA EUR H	3.28%	9.45%	-3.69%	12.58%
AA GBP H	3.70%	10.18%	-3.62%	17.96%
AA HKD(a)	4.04%	10.96%	–	28.73%
AA NZD H	3.70%	10.29%	-3.39%	32.15%
AA RMB H	5.25%	13.03%	-0.46%	46.85%
AA SGD H	3.70%	10.45%	-2.18%	26.82%
AA ZAR H	6.22%	15.46%	0.79%	85.63%
AK	3.69%	10.56%	-0.96%	37.09%
AK EUR(a)	6.05%	11.74%	–	51.20%
AK EUR H	3.24%	9.46%	-3.66%	20.31%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AR EUR H	3.38%	9.53%	-3.77%	14.35%
AT	3.64%	10.42%	-0.96%	340.51%
AT AUD H	3.55%	9.97%	-4.19%	103.83%
AT CAD H	3.74%	10.35%	-2.81%	52.37%
AT EUR(a)	6.00%	11.41%	–	145.82%
AT EUR H	3.28%	9.44%	-3.78%	66.39%
AT GBP H	3.63%	10.19%	-3.62%	54.95%
AT HKD(a)	4.00%	10.90%	–	211.90%
AT NZD H	3.65%	10.22%	-3.45%	53.06%
AT RMB H	5.24%	13.04%	-0.45%	85.36%
AT SGD(a)	4.60%	9.27%	–	106.98%
AT SGD H	3.81%	10.57%	-2.19%	51.48%
B	3.12%	9.56%	-2.07%	180.29%
B2	3.22%	9.55%	-1.93%	258.97%
BA	3.27%	9.57%	-1.98%	22.76%
BA AUD H	3.12%	9.05%	-5.37%	22.59%
BA ZAR H	5.69%	14.36%	-0.48%	71.08%
BT	3.41%	9.56%	-1.98%	178.08%
BT AUD H	3.05%	8.97%	-5.19%	82.19%
BT CAD H	3.23%	9.36%	-3.81%	36.07%
BT EUR H	2.70%	8.28%	-4.75%	48.04%
BT GBP H	3.12%	9.02%	-4.66%	40.23%
BT HKD(a)	3.63%	9.86%	–	175.51%
BT NZD H	3.23%	9.20%	-4.41%	41.08%
C	3.40%	10.15%	-1.44%	206.88%
C EUR(a)	5.38%	11.19%	–	145.28%
C2	3.49%	10.07%	-1.41%	145.90%
C2 EUR(a)	5.79%	11.22%	–	168.99%
C2 EUR H	3.07%	8.97%	-4.16%	32.07%
CK	3.51%	10.08%	-1.49%	31.76%
CK EUR H	3.05%	8.98%	-4.23%	15.95%
CT	3.46%	10.03%	-1.39%	46.68%
EA	3.51%	10.08%	-1.39%	12.55%
EA AUD H	3.40%	9.55%	-4.84%	6.49%
EA ZAR H	5.91%	14.82%	0.33%	19.32%
I	3.90%	11.24%	-0.29%	315.10%
I EUR(a)	5.89%	12.28%	–	209.04%
I2	4.00%	11.14%	-0.49%	124.30%
I2 AUD H	3.90%	10.66%	-3.61%	100.67%
I2 CHF H	3.43%	9.76%	-3.27%	14.67%
I2 EUR(a)	6.29%	12.35%	–	159.18%
I2 EUR H	3.54%	10.05%	-3.32%	77.40%
I2 SGD(a)	4.96%	9.79%	–	77.24%
I2 SGD H	4.01%	11.06%	-1.61%	31.27%
IA AUD H	3.82%	10.59%	-3.76%	37.87%
IQD	4.07%	11.21%	-0.45%	65.13%
IQD EUR(a)	6.31%	12.35%	–	96.01%
IT	3.99%	11.22%	-0.44%	41.08%
IT AUD H	3.93%	10.62%	-3.71%	43.99%
IT CAD H	3.87%	10.85%	-2.31%	36.27%
IT EUR H	3.55%	10.03%	-3.20%	5.64%
IT GBP H	3.88%	10.70%	-3.07%	32.36%
IT HKD(a)	4.26%	11.59%	–	41.28%
IT NZD H	3.95%	10.80%	-2.87%	40.80%
IT RMB H	5.53%	13.64%	0.11%	59.30%
J	3.11%	9.58%	-1.99%	190.47%
N2	3.42%	9.99%	-1.44%	35.07%
NT	3.43%	9.94%	-1.47%	35.15%
S1	4.09%	11.30%	-0.11%	100.20%
S1 EUR(a)	6.40%	12.47%	–	106.41%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
S1D	4.04%	11.33%	-0.12%	65.02%
SA	4.55%	12.33%	0.76%	47.98%
SHK	4.47%	12.27%	0.76%	46.78%
SK	4.21%	11.62%	0.11%	168.93%
W	3.97%	11.11%	-0.22%	10.78%
W EUR(a)	6.25%	12.28%	–	4.02%
W2	4.10%	11.35%	-0.19%	15.13%
W2 CHF H	3.43%	9.82%	-3.06%	4.40%
W2 EUR H	3.62%	10.33%	-3.13%	6.80%
WT	4.00%	11.21%	-0.17%	15.13%
WT AUD H	3.94%	10.75%	-3.50%	9.69%
WT CAD H	4.00%	10.99%	-2.32%	8.42%
WT EUR H	3.60%	10.03%	-2.99%	5.50%
WT GBP H	3.93%	10.84%	-3.08%	7.35%
WT RMB H	5.58%	13.72%	-0.13%	13.53%
American Income Portfolio				
Klasse				
A	2.08%	4.31%	2.54%	416.50%
A EUR(a)	4.41%	5.40%	–	119.82%
A2	2.24%	4.39%	2.61%	268.99%
A2 CHF H	1.66%	3.12%	-0.42%	14.60%
A2 DUR PH	1.40%	5.42%	0.34%	25.73%
A2 EUR(a)	4.51%	5.46%	–	117.95%
A2 EUR H	1.79%	3.38%	-0.10%	36.47%
A2 HKD(a)	2.53%	4.77%	–	123.60%
A2 PLN H	2.06%	3.94%	0.81%	9.95%
A2 SGD(a)	3.22%	3.15%	–	56.04%
A2 SGD H	2.25%	4.25%	1.76%	48.67%
AA	2.28%	4.41%	2.65%	36.10%
AA AUD H	2.18%	4.01%	0.26%	38.63%
AA CAD H	2.16%	4.16%	1.29%	26.15%
AA DUR PH	1.46%	5.42%	0.33%	24.79%
AA EUR H	1.81%	3.37%	-0.12%	15.04%
AA GBP H	2.16%	4.06%	0.24%	21.36%
AA HKD(a)	2.55%	4.76%	–	31.24%
AA NZD H	2.17%	4.16%	0.86%	36.59%
AA RMB H	3.75%	6.73%	3.28%	50.40%
AA SGD H	2.26%	4.37%	1.66%	30.40%
AA ZAR H	4.71%	9.13%	6.12%	93.82%
AK	2.21%	4.38%	2.69%	34.89%
AK EUR(a)	4.45%	5.37%	–	48.69%
AK EUR H	1.83%	3.38%	-0.08%	18.81%
AR EUR	4.50%	5.53%	-5.43%	23.15%
AR EUR H	1.74%	3.38%	-0.12%	12.97%
AT	2.22%	4.46%	2.55%	184.52%
AT AUD H	2.10%	3.99%	0.20%	82.61%
AT CAD H	2.17%	4.21%	1.24%	50.86%
AT DUR PH	1.41%	5.41%	0.32%	25.65%
AT EUR(a)	4.43%	5.42%	–	133.99%
AT EUR H	1.81%	3.41%	-0.18%	38.38%
AT GBP H	2.09%	3.97%	0.46%	37.90%
AT HKD(a)	2.45%	4.79%	–	123.54%
AT NZD H	2.15%	4.09%	0.89%	47.55%
AT RMB H	3.75%	6.75%	3.32%	72.03%
AT SGD(a)	3.13%	3.18%	–	75.03%
AT SGD H	2.24%	4.29%	1.65%	48.62%
B	1.72%	3.58%	1.83%	323.05%
B2	1.87%	3.66%	1.90%	210.60%
B2 HKD(a)	2.17%	4.04%	–	104.92%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
BA	1.91%	3.72%	1.88%	29.07%
BA AUD H	1.69%	3.19%	-0.45%	31.10%
BA ZAR H	4.44%	8.50%	5.33%	85.06%
BT	1.86%	3.60%	1.98%	151.56%
BT AUD H	1.74%	3.26%	-0.41%	69.59%
BT CAD H	1.80%	3.39%	0.58%	37.96%
BT EUR(a)	4.20%	4.67%	–	113.60%
BT EUR H	1.37%	2.60%	-0.79%	27.88%
BT GBP H	1.81%	3.32%	-0.29%	29.48%
BT HKD(a)	2.17%	4.01%	–	104.98%
BT NZD H	1.79%	3.44%	0.14%	39.04%
C	1.85%	3.84%	2.08%	340.51%
C EUR(a)	4.17%	4.92%	–	97.06%
C2	1.99%	3.90%	2.15%	339.76%
C2 DUR PH	1.17%	4.97%	-0.11%	21.07%
C2 EUR(a)	4.29%	5.00%	–	98.01%
C2 EUR H	1.56%	2.95%	-0.58%	30.07%
CT	2.00%	3.87%	2.15%	36.12%
EA	1.99%	3.90%	2.06%	12.14%
EA AUD H	1.89%	3.42%	-0.23%	7.38%
EA ZAR H	4.46%	8.72%	5.48%	21.19%
I	2.36%	4.88%	3.11%	297.44%
I EUR(a)	4.69%	5.96%	–	145.39%
I2	2.51%	4.98%	3.21%	132.90%
I2 AUD H	2.37%	4.60%	0.67%	15.27%
I2 CHF H	1.92%	3.62%	0.17%	20.20%
I2 DUR PH	1.67%	5.98%	0.88%	29.93%
I2 EUR(a)	4.73%	6.00%	–	154.21%
I2 EUR H	2.12%	3.99%	0.38%	47.80%
I2 HKD(a)	2.77%	5.35%	–	35.33%
I2 SGD(a)	3.45%	3.69%	–	64.46%
I2 SGD H	2.52%	4.83%	2.26%	33.07%
IA	2.52%	4.93%	3.15%	36.84%
IA AUD H	2.44%	4.60%	0.79%	34.30%
IT	2.52%	4.92%	3.18%	41.44%
IT AUD H	2.44%	4.57%	0.75%	43.27%
IT CAD H	2.41%	4.64%	1.76%	31.36%
IT EUR H	2.11%	3.96%	0.38%	21.29%
IT GBP H	2.41%	4.64%	0.99%	27.38%
IT HKD(a)	2.82%	5.31%	–	41.24%
IT JPY	5.79%	9.00%	2.89%	52.87%
IT JPY H	2.28%	4.37%	0.74%	22.63%
IT NZD H	2.55%	4.78%	1.44%	36.45%
IT RMB H	4.01%	7.27%	4.15%	15.57%
IT SGD(a)	3.51%	3.70%	–	27.72%
IT SGD H	2.53%	4.87%	2.32%	40.97%
J	1.73%	3.60%	1.86%	218.16%
L2	2.40%	4.64%	3.33%	8.13%
L2 AUD H	2.27%	4.30%	0.87%	5.20%
L2 SGD H	2.36%	4.56%	2.40%	7.07%
LT	2.40%	4.68%	3.29%	8.12%
LT AUD H	2.26%	4.25%	0.90%	5.19%
LT SGD H	2.40%	4.54%	2.42%	7.07%
N2	1.95%	3.80%	2.08%	29.20%
NT	1.95%	3.77%	2.05%	29.15%
S	2.91%	5.69%	3.98%	51.00%
S1	2.63%	5.19%	3.44%	68.87%
S1 EUR(a)	4.89%	6.29%	–	95.00%
S1D	2.60%	5.20%	3.42%	54.60%
S1D2	2.64%	5.19%	0.05%	5.23%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
SA	2.89%	5.72%	3.96%	46.94%
SHK	2.85%	5.67%	3.96%	39.60%
W	2.54%	5.06%	3.32%	20.19%
W2	2.61%	5.12%	3.37%	20.47%
W2 CHF H	1.99%	3.80%	0.32%	9.27%
W2 EUR H	2.15%	4.14%	0.63%	10.73%
WT	2.62%	5.15%	3.35%	20.49%
WT AUD H	2.49%	4.71%	0.97%	16.07%
WT EUR H	2.20%	4.14%	0.58%	7.78%
WT GBP H	2.49%	4.80%	0.65%	8.72%
WT HKD(a)	2.91%	5.53%	–	19.81%
WT SGD H	2.63%	5.01%	2.49%	17.66%
European Income Portfolio				
Klasse				
A	1.65%	4.69%	-0.44%	122.91%
A USD(a)	-0.54%	3.59%	–	139.80%
A2	1.70%	4.73%	-0.52%	121.40%
A2 CHF H	1.56%	4.37%	-0.73%	13.13%
A2 PLN H	1.95%	5.24%	0.48%	10.81%
A2 SGD H	2.13%	5.56%	1.11%	27.80%
A2 USD(a)	-0.53%	3.65%	–	141.37%
A2 USD H	2.05%	5.58%	1.95%	32.40%
AA	1.68%	4.66%	-0.42%	25.89%
AA AUD H	2.03%	5.32%	-0.47%	44.49%
AA HKD H	1.96%	5.51%	2.00%	33.56%
AA RMB H	3.34%	8.02%	2.53%	47.68%
AA SGD H	2.03%	5.50%	1.11%	36.43%
AA USD H	1.99%	5.62%	1.86%	41.05%
AK	1.73%	4.72%	-0.45%	31.68%
AR	1.64%	4.65%	-0.49%	17.78%
AT	1.79%	4.84%	-0.58%	117.03%
AT AUD H	1.94%	5.25%	-0.44%	100.04%
AT SGD H	2.07%	5.55%	1.05%	36.43%
AT USD(a)	-0.43%	3.71%	–	70.64%
AT USD H	2.10%	5.63%	1.88%	77.81%
B USD(a)	-0.90%	2.86%	–	104.33%
B2	1.33%	4.00%	-1.19%	89.80%
B2 USD(a)	-0.89%	2.94%	–	103.36%
BA	1.34%	4.03%	-1.18%	19.48%
BA AUD H	1.60%	4.59%	-1.21%	37.18%
BA USD H	1.65%	4.84%	1.19%	33.90%
BT	1.44%	4.11%	-1.28%	91.73%
BT AUD H	1.65%	4.52%	-1.13%	85.85%
BT USD(a)	-0.77%	2.99%	–	54.06%
BT USD H	1.67%	4.90%	1.17%	64.75%
C	1.42%	4.21%	-0.90%	97.79%
C USD(a)	-0.77%	3.12%	–	114.26%
C2	1.45%	4.23%	-0.89%	109.40%
C2 USD(a)	-0.72%	3.17%	–	128.35%
C2 USD H	1.83%	5.16%	1.46%	26.33%
CK	1.43%	4.24%	-0.98%	27.03%
CT USD H	1.82%	5.18%	1.43%	26.46%
I	1.92%	5.25%	0.11%	152.30%
I USD(a)	-0.27%	4.15%	–	256.86%
I2	1.99%	5.32%	0.00%	98.40%
I2 AUD H	2.25%	5.81%	0.10%	112.53%
I2 CHF H	0.23%	3.35%	-0.12%	15.27%
I2 USD(a)	-0.23%	4.22%	–	83.84%
I2 USD H	2.35%	6.24%	2.50%	88.53%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
European Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
IA	2.00%	5.31%	0.04%	23.14%
IA HKD H	2.23%	6.07%	2.66%	34.03%
IA SGD H	2.36%	6.13%	1.61%	33.98%
IA USD H	2.32%	6.18%	2.47%	37.80%
IT	1.97%	5.29%	0.01%	23.04%
IT SGD H	2.40%	6.16%	1.65%	34.14%
IT USD H	2.36%	6.25%	2.44%	40.52%
NT USD H	1.83%	5.07%	1.35%	18.93%
S1	2.10%	5.52%	0.35%	76.60%
S1 USD(a)	-0.14%	4.40%	–	54.58%
S1 USD H	2.44%	6.43%	2.72%	76.60%
S1D	2.11%	5.51%	0.32%	25.13%
SA USD H	2.68%	6.94%	3.19%	53.51%
SHK	2.31%	6.02%	0.78%	28.39%
W2	2.04%	5.41%	1.07%	6.53%
W2 CHF H	1.90%	5.12%	0.00%	10.87%
W2 USD H	2.43%	6.40%	3.13%	9.73%
WA	2.07%	5.46%	1.03%	6.54%
WA HKD H	2.31%	6.25%	3.21%	9.66%
WA USD H	2.39%	6.32%	3.16%	9.68%
WT	2.07%	5.45%	1.05%	6.56%
WT SGD H	2.49%	6.33%	2.34%	8.82%
WT USD H	2.45%	6.46%	3.12%	9.78%
Emerging Markets Debt Portfolio				
Klasse				
A	4.00%	5.90%	4.04%	139.88%
A EUR(a)	6.28%	7.04%	–	143.40%
A2	4.12%	6.01%	4.14%	141.20%
A2 CHF H	3.46%	4.57%	1.15%	9.73%
A2 EUR(a)	6.42%	7.10%	–	144.73%
A2 EUR H	3.62%	4.84%	1.38%	48.73%
A2 HKD(a)	4.40%	6.38%	–	80.73%
A2 PLN(a)(b)	2.56%	–	–	2.56%
A2 PLN H	3.69%	4.99%	2.01%	10.09%
A2 SGD H	4.04%	5.79%	2.83%	50.93%
AA	4.09%	6.02%	4.16%	39.15%
AA AUD H	3.89%	5.38%	0.40%	38.42%
AA CAD H	3.99%	5.54%	2.28%	24.05%
AA EUR H	3.54%	4.76%	1.41%	14.54%
AA GBP H	3.90%	5.35%	1.20%	19.85%
AA HKD(a)	4.37%	6.40%	–	31.95%
AA NZD H	4.00%	5.63%	1.26%	33.09%
AA RMB H	5.58%	8.25%	4.90%	53.04%
AA SGD H	4.12%	5.84%	2.87%	32.64%
AA ZAR H	6.46%	10.48%	6.44%	93.14%
AI	4.38%(2)	–	–	4.38%
AI AUD H	4.12%(2)	–	–	4.12%
AR EUR	6.39%	7.10%	-4.18%	27.86%
AT	4.06%	5.99%	4.07%	141.00%
AT AUD H	3.89%	5.32%	0.36%	88.22%
AT CAD H	4.02%	5.62%	2.19%	25.56%
AT EUR(a)	6.37%	7.13%	–	138.59%
AT EUR H	3.63%	4.82%	1.37%	49.11%
AT GBP H	3.93%	5.36%	1.15%	21.08%
AT HKD(a)	4.38%	6.39%	–	80.72%
AT NZD H	3.97%	5.55%	1.29%	40.21%
AT RMB H	5.59%	8.23%	4.93%	76.77%
AT SGD H	4.05%	5.81%	2.88%	50.82%
B2 EUR(a)	5.85%	6.02%	–	109.66%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
B2 HKD(a)	3.87%	5.33%	–	60.63%
BA	3.64%	5.00%	3.05%	29.05%
BA AUD H	3.49%	4.36%	-0.38%	28.62%
BA ZAR H	5.93%	9.40%	5.56%	78.60%
BT	3.55%	4.92%	3.09%	106.51%
BT AUD H	3.43%	4.41%	-0.51%	68.82%
BT EUR H	3.18%	3.91%	0.42%	33.79%
BT HKD(a)	3.86%	5.33%	–	60.66%
C	3.83%	5.50%	3.57%	124.15%
C EUR(a)	6.05%	6.56%	–	127.31%
C2	3.88%	5.51%	3.62%	124.80%
C2 EUR(a)	6.17%	6.57%	–	128.03%
C2 EUR H	3.40%	4.41%	0.94%	41.93%
CT	3.87%	5.53%	3.65%	26.40%
EA	3.82%	5.42%	2.90%	8.18%
EA AUD H	3.63%	4.74%	-0.18%	4.26%
EA ZAR H	6.16%	9.98%	4.62%	14.76%
EI	4.06%(2)	–	–	4.06%
EI AUD H	3.87%(2)	–	–	3.87%
I	4.43%	6.56%	4.70%	161.06%
I2	4.40%	6.58%	4.69%	162.40%
I2 CHF H	3.72%	5.11%	1.73%	15.13%
I2 EUR(a)	6.72%	7.69%	–	166.21%
I2 EUR H	3.88%	5.44%	1.93%	58.93%
IT AUD H	4.19%	6.01%	0.87%	39.00%
IT EUR H	3.86%	5.41%	1.98%	18.45%
IT SGD H	4.39%	6.42%	3.45%	32.82%
N2	3.83%	5.42%	3.55%	24.53%
NT	3.77%	5.44%	3.48%	24.52%
S	4.75%	7.33%	5.43%	85.43%
S EUR H	4.29%	6.24%	2.71%	63.53%
S GBP H	4.60%	6.80%	2.44%	72.80%
S1 2	4.46%	6.72%	4.83%	143.47%
S1 2 EUR(a)	6.80%	7.85%	–	190.42%
S1 EUR H	3.97%	5.69%	2.15%	53.60%
S1 GBP H	4.28%	6.19%	1.90%	62.40%
S1QD EUR H	3.95%	5.61%	2.07%	7.48%
SA	4.75%	7.32%	5.41%	49.90%

Mortgage Income Portfolio

Klasse				
A	1.86%	7.58%	-7.41%	21.69%
A2	1.95%	7.63%	-7.45%	22.20%
A2 EUR(a)	4.16%	8.76%	–	41.99%
A2 HKD(a)	2.25%	8.04%	–	7.24%
A2 SGD(a)	2.92%	6.38%	–	30.12%
A2X	2.02%	7.71%	-7.37%	38.06%
A2X EUR(a)	4.32%	8.81%	–	3.35%
AA	1.99%	7.61%	-7.42%	22.23%
AA AUD H	1.75%	7.13%	-9.57%	24.17%
AA HKD(a)	2.24%	7.96%	–	19.80%
AA RMB H	3.46%	10.06%	-7.07%	32.69%
AA SGD H	1.98%	7.52%	-8.34%	19.54%
AA ZAR H	4.38%	12.60%	-4.78%	77.90%
AR EUR H	1.51%	6.65%	-10.13%	4.35%
AT	1.96%	7.60%	-7.44%	22.06%
AT AUD H	1.85%	7.20%	-9.59%	24.24%
AT EUR(a)	4.17%	8.72%	–	41.87%
AT GBP H	1.84%	7.28%	-9.58%	-0.39%
AT HKD(a)	2.24%	8.00%	–	7.16%

	<u>6 Monate*</u>	<u>12 Monate</u>	<u>Vorjahr</u>	<u>Seit Auflegung</u>
Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AT SGD(a)	2.94%	6.34%	–	30.00%
AT SGD H	1.95%	7.61%	-8.40%	19.40%
AX	1.87%	7.75%	-7.37%	78.72%
AX EUR(a)	4.13%	8.91%	–	24.39%
B2X	1.72%	7.17%	-7.80%	30.22%
BX	1.65%	7.25%	-7.83%	58.14%
BX EUR(a)	3.91%	8.42%	–	-10.14%
C	1.72%	7.17%	-7.87%	17.73%
C2	1.67%	7.15%	-7.87%	17.93%
C2 EUR(a)	3.88%	8.24%	–	37.05%
C2X	1.74%	7.22%	-7.78%	16.87%
CX	1.65%	7.25%	-7.83%	58.00%
I	2.22%	8.19%	-6.90%	27.08%
I EUR(a)	4.44%	9.22%	–	47.49%
I2	2.25%	8.21%	-6.91%	27.33%
I2 EUR(a)	4.46%	9.33%	–	47.94%
I2 EUR H	1.77%	7.18%	-9.49%	-0.47%
I2X	2.26%	8.30%	-6.87%	27.44%
IT EUR H	1.77%	7.21%	-9.47%	-1.07%
IX	2.15%	8.36%	-6.80%	74.41%
N2	1.65%	7.08%	-7.99%	2.80%
NT	1.65%	7.05%	-7.92%	2.91%
S	2.65%	9.08%	-6.29%	34.45%
S1	2.30%	8.42%	-6.77%	29.50%
S1 EUR(a)	4.59%	9.54%	–	50.20%
S1 EUR H	1.89%	7.41%	-9.19%	-2.46%
S1 JPY	5.60%	12.62%	-7.05%	2.91%
S1X	2.28%	8.65%	-6.54%	39.55%
SA	2.57%	8.97%	-6.28%	31.44%

Die Wertentwicklung der Anteilklassen der einzelnen Portefeuilles basiert auf dem Nettoinventarwert zum 31. August 2021, wobei die Auswirkungen der von der Verwaltungsgesellschaft rückerstatteten bzw. erlassenen Aufwendungen einberechnet wurden. Verkaufsgebühren, die beim Kauf oder bei der Rücknahme von Anteilen erhoben werden können, wurden nicht berücksichtigt. Die Wertentwicklung der ausschüttenden Anteilklassen umfasst die während des Geschäftsjahres ausgeschütteten und wieder angelegten Beträge. Die Wertentwicklung in der Vergangenheit ist keine Garantie für aktuelle oder zukünftige Ergebnisse. Die Wertentwicklungszahlen berücksichtigen nicht die Provisionen und Kosten im Zusammenhang mit der Ausgabe und Rücknahme von Anteilen. Anlagerenditen und der Wert des angelegten Kapitals unterliegen Schwankungen, so dass die Anteile eines Anlegers bei Rücknahme mehr oder weniger als die ursprünglichen Anschaffungskosten wert sein können.

* Sechsmonatszeitraum zum 31. August 2021.

- (a) Auflegungsdatum der Anteilkategorie: 15. Juli 2021. Die vor der Auflegung genannte Wertentwicklung ist simuliert.
- (b) Rendite berechnet ab 24. Juni 2021.

Rendite berechnet ab Auflegungsdatum am:

- (1) 11. Mai 2021
- (2) 4. März 2021

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Allice USA, Inc. - Class A	854	\$ 23,434	0.1%
Cable One, Inc.	5	10,498	0.0
Charter Communications, Inc. - Class A	119	97,182	0.2
Comcast Corp. - Class A	4,548	275,973	0.6
Deutsche Telekom AG (REG)	4,170	88,668	0.2
Liberty Global PLC	894	25,908	0.1
Spark New Zealand Ltd.	5,708	19,600	0.0
		<u>541,263</u>	<u>1.2</u>
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	343	49,807	0.1
Nintendo Co., Ltd.	72	34,592	0.1
Walt Disney Co. (The)	990	179,487	0.4
		<u>263,886</u>	<u>0.6</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class A	43	124,440	0.3
Alphabet, Inc. - Class C	141	410,202	0.9
Facebook, Inc. - Class A	1,835	696,542	1.5
		<u>1,231,184</u>	<u>2.7</u>
MEDIEN			
Fox Corp. - Class A	818	30,626	0.0
Fox Corp. - Class B	178	6,164	0.0
Publicis Groupe SA	559	36,698	0.1
		<u>73,488</u>	<u>0.1</u>
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
SoftBank Corp.	1,800	24,089	0.1
SoftBank Group Corp.	1,750	98,619	0.2
		<u>122,708</u>	<u>0.3</u>
		<u>2,232,529</u>	<u>4.9</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	1,620	246,548	0.6
Faurecia SE	1,870	90,341	0.2
Magna International, Inc. - Class A (United States)	207	16,346	0.0
		<u>353,235</u>	<u>0.8</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Daimler AG	179	15,100	0.0
Stellantis NV	5,525	110,752	0.2
Tesla, Inc.	108	79,458	0.2
Toyota Motor Corp.	825	71,852	0.2
		<u>277,162</u>	<u>0.6</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Service Corp. International/US	1,806	113,344	0.2
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	945	31,365	0.1
Chipotle Mexican Grill, Inc. - Class A	37	70,423	0.2
Compass Group PLC	3,264	67,434	0.1
Domino's Pizza Enterprises Ltd.	632	72,224	0.2
Domino's Pizza, Inc.	135	69,780	0.1
Entain PLC	3,220	85,574	0.2
Galaxy Entertainment Group Ltd.	14,450	92,648	0.2
Restaurant Brands International, Inc.	1,210	77,694	0.2
		<u>567,142</u>	<u>1.3</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Electrolux AB - Class B	1,108	28,156	0.1
PulteGroup, Inc.	1,430	77,020	0.1
		<u>105,176</u>	<u>0.2</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd. (ADR)	1,303	217,588	0.5
Amazon.com, Inc.	163	565,738	1.2
HelloFresh SE	224	24,185	0.1
Prosus NV	2,019	178,713	0.4
		<u>986,224</u>	<u>2.2</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Canadian Tire Corp., Ltd. - Class A	49	\$ 7,457	0.0%
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	42	65,064	0.2
Best Buy Co., Inc.	100	11,651	0.0
Lowe's Cos., Inc.	88	17,942	0.0
O'Reilly Automotive, Inc.	86	51,091	0.1
TJX Cos., Inc. (The)	2,830	205,798	0.5
		<u>351,546</u>	<u>0.8</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Carter's, Inc.	510	52,214	0.1
EssilorLuxottica SA	168	33,010	0.1
Kering SA	40	31,861	0.1
Lululemon Athletica, Inc.	38	15,206	0.0
NIKE, Inc. - Class B	1,101	181,379	0.4
Pandora A/S	462	55,377	0.1
Swatch Group AG (The)	186	52,481	0.1
Tapestry, Inc.	1,940	78,221	0.2
		<u>499,749</u>	<u>1.1</u>
		<u>3,261,035</u>	<u>7.2</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Asahi Group Holdings Ltd.	2,574	119,651	0.3
Coca-Cola Co. (The)	3,760	211,726	0.5
Constellation Brands, Inc. - Class A	297	62,709	0.1
PepsiCo, Inc.	118	18,454	0.0
Treasury Wine Estates Ltd.	3,382	31,149	0.1
		<u>443,689</u>	<u>1.0</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Costco Wholesale Corp.	200	91,098	0.2
J Sainsbury PLC	4,657	19,465	0.0
Kesko Oyj - Class B	217	8,979	0.0
Koninklijke Ahold Delhaize NV	2,043	68,926	0.2
Kroger Co. (The)	1,511	69,551	0.2
		<u>258,019</u>	<u>0.6</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Bunge Ltd.	778	58,902	0.1
Hain Celestial Group, Inc. (The)	2,020	75,568	0.2
Nestle SA (REG)	1,374	173,521	0.4
Nichirei Corp.	2,100	53,543	0.1
Salmar ASA	740	49,601	0.1
		<u>411,135</u>	<u>0.9</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
Lion Corp.	200	3,403	0.0
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Estee Lauder Cos., Inc. (The) - Class A	222	75,589	0.1
TABAK			
Philip Morris International, Inc.	1,280	131,840	0.3
		<u>1,323,675</u>	<u>2.9</u>
ENERGIE			
ENERGIE-AUSRÜSTUNG UND -DIENSTE			
Baker Hughes Co. - Class A	1,572	35,810	0.1
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
BP PLC	10,552	42,929	0.1
Idemitsu Kosan Co., Ltd.	600	14,370	0.0
Inpex Corp.	2,900	19,926	0.1
LUKOIL PJSC (Sponsored ADR)	647	55,351	0.1
Neste Oyj	584	35,572	0.1
OMV AG	1,169	64,752	0.1
Parkland Corp./Canada	235	7,016	0.0
Repsol SA	5,665	65,007	0.1
Royal Dutch Shell PLC - Class A	4,500	89,518	0.2
Royal Dutch Shell PLC - Class A (London)	1,115	22,099	0.1
Royal Dutch Shell PLC - Class B	3,408	67,061	0.2
		<u>483,601</u>	<u>1.1</u>
		<u>519,411</u>	<u>1.2</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
FINANZWERTE			
BANKEN			
ABN AMRO Bank NV (GDR)	3,630	\$ 50,572	0.1%
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA	4,217	27,600	0.1
Bank Leumi Le-Israel BM	7,260	59,976	0.1
Bank of America Corp.	2,647	110,512	0.2
Bank of Ireland Group PLC	21,790	136,290	0.3
Bank Polska Kasa Opieki SA	2,200	61,520	0.1
Citigroup, Inc.	61	4,387	0.0
Commonwealth Bank of Australia	674	49,109	0.1
FinecoBank Banca Fineco SpA	1,534	28,259	0.1
Grupo Financiero Banorte SAB de CV - Class O	13,220	87,262	0.2
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	15,200	43,540	0.1
JPMorgan Chase & Co.	677	108,286	0.2
Jyske Bank A/S	1,174	51,250	0.1
KB Financial Group, Inc.	1,520	69,145	0.2
National Bank of Canada	862	68,419	0.2
Nordea Bank Abp	7,450	87,501	0.2
Oversea-Chinese Banking Corp., Ltd.	2,300	19,464	0.0
Societe Generale SA	2,034	64,018	0.1
SVB Financial Group	67	37,487	0.1
Toronto-Dominion Bank (The)	448	29,093	0.1
Wells Fargo & Co.	2,000	91,400	0.2
		<u>1,285,090</u>	<u>2.8</u>
KAPITALMÄRKTE			
Apollo Global Management, Inc.	60	3,587	0.0
BlackRock, Inc. - Class A	109	102,819	0.2
Carlyle Group, Inc. (The)	1,381	68,194	0.2
Charles Schwab Corp. (The)	4,143	301,817	0.7
CME Group, Inc. - Class A	264	53,254	0.1
Credit Suisse Group AG (REG)	8,431	89,314	0.2
Euronext NV	387	44,909	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	343	141,834	0.3
Julius Baer Group Ltd.	1,979	135,074	0.3
London Stock Exchange Group PLC	475	52,033	0.1
Moody's Corp.	493	187,720	0.4
MSCI, Inc. - Class A	117	74,246	0.2
Raymond James Financial, Inc.	39	5,456	0.0
Singapore Exchange Ltd.	2,550	18,716	0.0
		<u>1,278,973</u>	<u>2.8</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
Ally Financial, Inc.	1,298	68,664	0.2
American Express Co.	886	147,040	0.3
Capital One Financial Corp.	310	51,451	0.1
		<u>267,155</u>	<u>0.6</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Groupe Bruxelles Lambert SA	446	51,096	0.1
Industrivarden AB	1,027	37,812	0.1
Investor AB	2,957	70,728	0.2
Kinnevik AB	1,051	41,179	0.1
		<u>200,815</u>	<u>0.5</u>
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd.	10,800	128,960	0.3
Athene Holding Ltd. - Class A	734	49,156	0.1
Aviva PLC	1,675	9,310	0.0
CNP Assurances	1,037	17,769	0.0
Everest Re Group Ltd.	207	54,834	0.1
Japan Post Insurance Co., Ltd.	2,200	39,952	0.1
MetLife, Inc.	361	22,382	0.1
PICC Property & Casualty Co., Ltd. - Class H	52,000	47,014	0.1
Prudential Financial, Inc.	372	39,387	0.1
Suncorp Group Ltd.	11,690	106,368	0.2
		<u>515,132</u>	<u>1.1</u>
		<u>3,547,165</u>	<u>7.8</u>
GESUNDHEITSWESSEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Genmab A/S	420	198,968	0.4
Horizon Therapeutics PLC	309	33,400	0.1
Moderna, Inc.	34	12,807	0.0
Seagen, Inc.	188	31,509	0.1
		<u>276,684</u>	<u>0.6</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Abbott Laboratories	1,519	\$ 191,956	0.4%
Cooper Cos., Inc. (The)	151	68,057	0.1
DexCom, Inc.	116	61,413	0.1
Hologic, Inc.	298	23,587	0.1
IDEXX Laboratories, Inc.	99	66,702	0.1
Koninklijke Philips NV	5,625	259,218	0.6
Medtronic PLC	1,750	233,590	0.5
Smith & Nephew PLC	3,910	74,873	0.2
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	550	82,747	0.2
		<u>1,062,143</u>	<u>2.3</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Anthem, Inc.	828	310,608	0.7
Centene Corp.	840	52,903	0.1
Henry Schein, Inc.	598	45,203	0.1
Molina Healthcare, Inc.	254	68,267	0.1
UnitedHealth Group, Inc.	188	78,259	0.2
		<u>555,240</u>	<u>1.2</u>
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Cerner Corp.	262	20,004	0.1
Change Healthcare, Inc.	1,610	35,146	0.1
Veeva Systems, Inc. - Class A	175	58,096	0.1
		<u>113,246</u>	<u>0.3</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	85	68,410	0.2
Eurofins Scientific SE	424	60,162	0.1
IQVIA Holdings, Inc.	913	237,133	0.5
Lonza Group AG	170	143,774	0.3
Mettler-Toledo International, Inc.	28	43,479	0.1
Thermo Fisher Scientific, Inc.	177	98,226	0.2
Waters Corp.	173	71,625	0.2
		<u>722,809</u>	<u>1.6</u>
PHARMAZEUTIKA			
AstraZeneca PLC (Sponsored ADR)	919	53,559	0.1
Eli Lilly & Co.	350	90,402	0.2
Johnson & Johnson	30	5,194	0.0
Novo Nordisk A/S - Class B	843	84,393	0.2
Pfizer, Inc.	932	42,937	0.1
Roche Holding AG	783	314,418	0.7
Sanofi	1,253	129,859	0.3
Sumitomo Dainippon Pharma Co., Ltd.	2,200	39,490	0.1
Takeda Pharmaceutical Co., Ltd.	1,500	49,928	0.1
Zoetis, Inc.	1,051	214,993	0.5
		<u>1,025,173</u>	<u>2.3</u>
		<u>3,755,295</u>	<u>8.3</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	661	90,422	0.2
Huntington Ingalls Industries, Inc.	316	64,518	0.2
		<u>154,940</u>	<u>0.4</u>
LUFTFRACHT UND LOGISTIK			
Expeditors International of Washington, Inc.	124	15,456	0.0
Kuehne & Nagel International AG	186	67,977	0.2
		<u>83,433</u>	<u>0.2</u>
BAUPRODUKTE			
Cie de Saint-Gobain	640	46,395	0.1
Lennox International, Inc.	199	66,701	0.2
Otis Worldwide Corp.	2,356	217,270	0.5
Xinyi Glass Holdings Ltd.	15,000	63,034	0.1
		<u>393,400</u>	<u>0.9</u>
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
ADT, Inc.	6,826	58,430	0.1
Copart, Inc.	193	27,854	0.1
Herman Miller, Inc.	1,100	46,233	0.1
Secom Co., Ltd.	550	41,708	0.1
		<u>174,225</u>	<u>0.4</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
AECOM	920	60,315	0.1

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
ABB Ltd. (REG)	295	\$ 10,913	0.0%
Nidec Corp.	1,730	197,616	0.4
Regal Beloit Corp.	550	82,181	0.2
Rockwell Automation, Inc.	220	71,599	0.2
Vertiv Holdings Co.	1,624	45,748	0.1
		<u>408,057</u>	<u>0.9</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
3M Co.	563	109,639	0.2
MASCHINEN			
Alstom SA	4,891	210,280	0.5
Cummins, Inc.	293	69,142	0.2
Dover Corp.	642	111,939	0.2
Mitsubishi Heavy Industries Ltd.	2,500	66,047	0.1
Parker-Hannifin Corp.	178	52,807	0.1
Techtronic Industries Co., Ltd.	2,500	55,331	0.1
Volvo AB - Class B	3,084	69,830	0.2
		<u>635,376</u>	<u>1.4</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Booz Allen Hamilton Holding Corp.	729	59,712	0.1
Recruit Holdings Co., Ltd.	3,700	217,864	0.5
RELX PLC	2,010	60,457	0.1
Robert Half International, Inc.	1,636	169,162	0.4
Verisk Analytics, Inc. - Class A	909	183,400	0.4
		<u>690,595</u>	<u>1.5</u>
STRASSE UND SCHIENE			
Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	1,590	82,569	0.2
Nippon Express Co., Ltd.	900	61,197	0.1
		<u>143,766</u>	<u>0.3</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Air Lease Corp.	1,720	68,353	0.2
Ashtead Group PLC	2,981	233,034	0.5
WW Grainger, Inc.	106	45,972	0.1
		<u>347,359</u>	<u>0.8</u>
		<u>3,201,105</u>	<u>7.1</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Arrow Electronics, Inc.	552	66,914	0.1
IPG Photonics Corp.	190	32,429	0.1
Keyence Corp.	280	168,094	0.4
Murata Manufacturing Co., Ltd.	2,120	174,768	0.4
Zebra Technologies Corp. - Class A	37	21,725	0.0
		<u>463,930</u>	<u>1.0</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
21Vianet Group, Inc. (ADR)	1,260	24,935	0.1
Accenture PLC - Class A	251	84,477	0.2
Akamai Technologies, Inc.	512	57,984	0.1
Automatic Data Processing, Inc.	1,011	211,339	0.5
Capgemini SE	1,355	304,587	0.7
Cognizant Technology Solutions Corp. - Class A	2,280	173,987	0.4
EPAM Systems, Inc.	76	48,094	0.1
Gartner, Inc.	124	38,284	0.1
Mastercard, Inc. - Class A	695	240,630	0.5
Visa, Inc. - Class A	391	89,578	0.2
Western Union Co. (The) - Class W	2,811	60,830	0.1
		<u>1,334,725</u>	<u>3.0</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Advanced Micro Devices, Inc.	514	56,910	0.1
Applied Materials, Inc.	979	132,292	0.3
ASML Holding NV	473	394,476	0.9
Broadcom, Inc.	130	64,637	0.2
Infineon Technologies AG	996	42,408	0.1
Lam Research Corp.	94	56,853	0.1
NVIDIA Corp.	232	51,933	0.1
NXP Semiconductors NV	260	55,934	0.1
ON Semiconductor Corp.	1,450	64,322	0.1
QUALCOMM, Inc.	578	84,787	0.2
		<u>1,004,552</u>	<u>2.2</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	152	\$ 100,882	0.2%
Avast PLC	4,585	37,708	0.1
Bentley Systems, Inc.	631	40,693	0.1
Citrix Systems, Inc.	630	64,808	0.1
CommVault Systems, Inc.	751	60,809	0.1
Constellation Software, Inc./Canada	21	35,590	0.1
Fortinet, Inc.	186	58,616	0.1
Microsoft Corp.	3,100	935,828	2.1
NortonLifeLock, Inc.	4,909	130,383	0.3
Oracle Corp.	2,521	224,697	0.5
SAP SE	2,097	314,991	0.7
Trade Desk, Inc. (The) - Class A	224	17,931	0.0
Trend Micro, Inc./Japan	670	36,702	0.1
VMware, Inc. - Class A	535	79,645	0.2
		<u>2,139,283</u>	<u>4.7</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	2,241	340,251	0.8
NetApp, Inc.	729	64,830	0.2
Samsung Electronics Co., Ltd.	4,400	290,480	0.6
Western Digital Corp.	2,140	135,248	0.3
		<u>830,809</u>	<u>1.9</u>
		<u>5,773,299</u>	<u>12.8</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Celanese Corp. - Class A	430	68,198	0.2
International Flavors & Fragrances, Inc.	961	145,592	0.3
Linde PLC	346	108,848	0.2
LyondellBasell Industries NV - Class A	500	50,175	0.1
Mitsubishi Chemical Holdings Corp.	1,900	16,682	0.0
Sumitomo Chemical Co., Ltd.	13,200	66,919	0.2
Tosoh Corp.	4,600	83,492	0.2
Umicore SA	604	39,744	0.1
		<u>579,650</u>	<u>1.3</u>
CONTAINER UND VERPACKUNGEN			
Packaging Corp. of America	34	5,158	0.0
METALL UND BERGBAU			
Agnico Eagle Mines Ltd.	591	34,008	0.1
BHP Group Ltd.	441	14,591	0.0
Evraz PLC	5,004	40,704	0.1
Fortescue Metals Group Ltd.	1,644	25,063	0.0
Norsk Hydro ASA	5,245	36,208	0.1
Northern Star Resources Ltd.	4,150	29,523	0.1
Rio Tinto Ltd.	195	15,866	0.0
		<u>195,963</u>	<u>0.4</u>
PAPIER- UND HOLZPRODUKTE			
Oji Holdings Corp.	800	4,188	0.0
		<u>784,959</u>	<u>1.7</u>
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
American Tower Corp.	493	144,040	0.3
Americold Realty Trust	2,430	89,278	0.2
Iron Mountain, Inc.	140	6,685	0.0
MGM Growth Properties LLC - Class A	1,620	67,165	0.2
Orix JREIT, Inc.	23	40,997	0.1
VICI Properties, Inc.	2,096	64,788	0.1
Weyerhaeuser Co.	1,953	70,308	0.2
		<u>483,261</u>	<u>1.1</u>
IMMOBILIENENTWICKLUNG			
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	78,000	52,433	0.1
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Aroundtown SA	7,540	57,777	0.1
CBRE Group, Inc. - Class A	1,055	101,596	0.2
Nomura Real Estate Holdings, Inc.	2,600	66,584	0.2
		<u>225,957</u>	<u>0.5</u>
		<u>761,651</u>	<u>1.7</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
EDP - Energias de Portugal SA			20,631	\$ 113,255	0.2%
Enel SpA			11,680	106,410	0.2
Iberdrola SA			2,806	34,770	0.1
NRG Energy, Inc.			1,509	68,916	0.2
				<u>323,351</u>	<u>0.7</u>
GASVERSORGUNGSBETRIEBE					
AltaGas Ltd.			764	15,302	0.0
China Resources Gas Group Ltd.			9,500	57,654	0.1
Kunlun Energy Co., Ltd.			92,000	97,303	0.2
UGI Corp.			1,402	64,927	0.2
				<u>235,186</u>	<u>0.5</u>
				<u>558,537</u>	<u>1.2</u>
				<u>25,718,661</u>	<u>56.8</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
AUSTRALIEN					
Australia Government Bond, Series 142	4.25%	04/21/2026	AUD 95	81,313	0.2
Australia Government Bond, Series 144	3.75%	04/21/2037	70	66,364	0.1
Australia Government Bond, Series 145	2.75%	06/21/2035	140	118,894	0.3
Australia Government Bond, Series 150	3.00%	03/21/2047	140	122,167	0.3
Australia Government Bond, Series 162	1.75%	06/21/2051	30	20,357	0.0
				<u>409,095</u>	<u>0.9</u>
ÖSTERREICH					
Republic of Austria Government Bond	0.00%	02/20/2031	EUR 120	143,779	0.3
Republic of Austria Government Bond	0.50%	02/20/2029	78	97,900	0.2
				<u>241,679</u>	<u>0.5</u>
KOLUMBIEN					
Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP 368,300	94,364	0.2
FINNLAND					
Finland Government Bond	0.50%	09/15/2029	EUR 29	36,540	0.1
DEUTSCHLAND					
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	0.00%	02/15/2031	255	313,560	0.7
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 2007	4.25%	07/04/2039	5	10,666	0.0
Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series G	0.00%	08/15/2050	40	46,548	0.1
				<u>370,774</u>	<u>0.8</u>
IRLAND					
Ireland Government Bond	0.00%	10/18/2031	145	171,112	0.4
ITALIEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.25%	03/15/2028	230	271,138	0.6
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.50%	07/15/2028	245	292,567	0.6
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	0.95%	09/15/2027	515	635,653	1.4
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	1.50%	04/30/2045	34	39,989	0.1
				<u>1,239,347</u>	<u>2.7</u>
JAPAN					
Japan Government Five Year Bond, Series 133	0.10%	09/20/2022	JPY 49,550	451,443	1.0
Japan Government Ten Year Bond, Series 358	0.10%	03/20/2030	46,900	431,821	1.0
Japan Government Ten Year Bond, Series 359	0.10%	06/20/2030	31,700	291,834	0.6
Japan Government Ten Year Bond, Series 360	0.10%	09/20/2030	11,450	105,266	0.2
Japan Government Thirty Year Bond, Series 62	0.50%	03/20/2049	13,950	123,949	0.3
Japan Government Thirty Year Bond, Series 65	0.40%	12/20/2049	11,350	97,585	0.2
Japan Government Thirty Year Bond, Series 68	0.60%	09/20/2050	13,350	120,453	0.3
Japan Government Twenty Year Bond, Series 171	0.30%	12/20/2039	10,350	93,188	0.2
Japan Government Two Year Bond, Series 412	0.10%	05/01/2022	17,100	155,664	0.3
				<u>1,871,203</u>	<u>4.1</u>
MALAYSIA					
Malaysia Government Bond, Series 0310	4.50%	04/15/2030	MYR 245	64,107	0.1
MEXIKO					
Mexican Bonos, Series M	7.75%	05/29/2031	MXN 4,302	225,821	0.5
SPANIEN					
Spain Government Bond	1.20%	10/31/2040	EUR 255	314,489	0.7
THAILAND					
Thailand Government Bond	1.59%	12/17/2035	THB 1,100	32,473	0.1
VEREINIGTES KÖNIGREICH					
United Kingdom Gilt	1.25%	07/31/2051	GBP 45	64,615	0.2
United Kingdom Gilt	1.75%	09/07/2037	152	232,910	0.5
				<u>297,525</u>	<u>0.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	1.13%	05/15/2040	USD 35	\$ 31,161	0.1%
U.S. Treasury Bonds	1.13%	08/15/2040	375	332,812	0.7
U.S. Treasury Bonds	1.88%	02/15/2051	195	192,380	0.4
U.S. Treasury Notes	0.13%	08/15/2023	782	780,900	1.7
U.S. Treasury Notes	0.25%	03/15/2024	159	158,752	0.4
U.S. Treasury Notes	0.25%	05/31/2025	347	342,825	0.8
U.S. Treasury Notes	0.75%	04/30/2026	387	387,423	0.9
U.S. Treasury Notes	1.63%	10/31/2026	235	244,841	0.5
U.S. Treasury Notes	2.13%	05/31/2026	180	191,644	0.4
				<u>2,662,738</u>	<u>5.9</u>
				<u>8,031,267</u>	<u>17.7</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	0.60%	01/15/2027	EUR 100	120,713	0.2
Banco de Credito del Peru	3.13%	07/01/2030	USD 40	39,775	0.1
Banco Santander SA	1.13%	06/23/2027	EUR 100	123,913	0.3
Bank of America Corp.	2.69%	04/22/2032	USD 61	63,472	0.1
Citigroup, Inc.	3.98%	03/20/2030	45	51,149	0.1
Citigroup, Inc.	4.08%	04/23/2029	27	30,617	0.1
Credit Suisse AG/London	0.25%	01/05/2026	EUR 100	118,826	0.2
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.60%	02/07/2030	USD 28	29,186	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	3.38%	03/27/2025	EUR 45	59,450	0.1
HSBC Holdings PLC, Series GEN	0.31%	11/13/2026	100	118,887	0.2
JPMorgan Chase & Co.	1.09%	03/11/2027	100	123,076	0.3
Standard Chartered PLC	1.63%	10/03/2027	100	126,363	0.3
US Bancorp, Series J(a)	5.30%	04/15/2027	USD 27	30,910	0.1
Wells Fargo & Co.	1.00%	02/02/2027	EUR 100	122,763	0.3
				<u>1,159,100</u>	<u>2.5</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series I(a)	4.00%	06/01/2026	USD 38	39,975	0.1
SURA Asset Management SA	4.88%	04/17/2024	100	107,750	0.2
				<u>147,725</u>	<u>0.3</u>
FINANZEN					
Air Lease Corp.	2.10%	09/01/2028	3	2,947	0.0
Air Lease Corp.	3.25%	03/01/2025	2	2,124	0.0
Air Lease Corp.	3.63%	04/01/2027	9	9,724	0.0
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	5	5,029	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	13	14,087	0.1
GE Capital European Funding Unlimited Co.	4.63%	02/22/2027	EUR 50	73,309	0.2
Synchrony Financial	3.95%	12/01/2027	USD 10	11,161	0.0
				<u>118,381</u>	<u>0.3</u>
VERSICHERUNGEN					
Alleghany Corp.	3.63%	05/15/2030	6	6,689	0.0
REITs					
Essential Properties LP	2.95%	07/15/2031	36	36,351	0.1
Vornado Realty LP	3.40%	06/01/2031	38	39,694	0.1
				<u>76,045</u>	<u>0.2</u>
				<u>1,507,940</u>	<u>3.3</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Suzano Austria GmbH	3.75%	01/15/2031	35	36,790	0.1
Yamana Gold, Inc.	2.63%	08/15/2031	27	26,914	0.0
				<u>63,704</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Charter Communications Operating LLC/Charter Communications Operating Capital	5.38%	05/01/2047	20	24,599	0.1
Discovery Communications LLC	4.65%	05/15/2050	9	10,660	0.0
Discovery Communications LLC	5.20%	09/20/2047	16	20,130	0.0
Discovery Communications LLC	5.30%	05/15/2049	9	11,491	0.0
ViacomCBS, Inc.	5.50%	05/15/2033	25	32,117	0.1
				<u>98,997</u>	<u>0.2</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	1.60%	05/19/2028	EUR 100	127,552	0.2
AT&T, Inc.	3.50%	09/15/2053	USD 35	35,927	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	19	29,334	0.1
Corning, Inc.	5.45%	11/15/2079	20	28,360	0.1
T-Mobile USA, Inc.	3.40%	10/15/2052	39	39,578	0.1
				<u>260,751</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ						
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	USD	43 \$	45,762	0.1%
Volkswagen Bank GmbH.	1.25%	12/15/2025	EUR	35	43,283	0.1
					89,045	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
Las Vegas Sands Corp.	3.90%	08/08/2029	USD	30	31,585	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043		26	33,522	0.1
					65,107	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER						
CK Hutchison Finance 16 II Ltd.	0.88%	10/03/2024	EUR	100	121,455	0.3
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027	USD	9	10,440	0.0
					131,895	0.3
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
Altria Group, Inc.	3.40%	05/06/2030		37	39,654	0.1
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.	5.55%	01/23/2049		30	41,784	0.1
Banner Health	2.34%	01/01/2030		31	32,023	0.1
BAT Capital Corp.	4.91%	04/02/2030		40	46,455	0.1
Baylor Scott & White Holdings, Series 2021	1.78%	11/15/2030		38	37,675	0.1
Gilead Sciences, Inc.	4.80%	04/01/2044		20	25,708	0.0
Sutter Health, Series 20A.	2.29%	08/15/2030		27	27,659	0.1
					250,958	0.6
ENERGIE						
Cenovus Energy, Inc.	4.40%	04/15/2029		27	30,344	0.1
Chevron USA, Inc.	5.25%	11/15/2043		45	62,027	0.1
Devon Energy Corp.	5.60%	07/15/2041		33	41,306	0.1
Enbridge Energy Partners LP.	7.38%	10/15/2045		26	41,637	0.1
Energy Transfer LP	6.25%	04/15/2049		45	59,615	0.1
Eni SpA	0.38%	06/14/2028	EUR	100	119,542	0.3
Exxon Mobil Corp.	0.84%	06/26/2032		100	119,519	0.3
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.55%	12/15/2029	USD	4	4,244	0.0
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	3.80%	09/15/2030		8	8,616	0.0
Suncor Energy, Inc.	6.50%	06/15/2038		9	12,658	0.0
Suncor Energy, Inc.	6.85%	06/01/2039		18	26,360	0.1
TransCanada PipeLines Ltd.	7.63%	01/15/2039		23	36,023	0.1
Valero Energy Corp.	6.63%	06/15/2037		9	12,284	0.0
					574,175	1.3
TECHNOLOGIE						
Broadcom Corp./Broadcom Cayman Finance Ltd.	3.88%	01/15/2027		17	18,701	0.1
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028		10	11,223	0.0
Broadcom, Inc.	5.00%	04/15/2030		7	8,303	0.0
Fidelity National Information Services, Inc.	0.63%	12/03/2025	EUR	100	121,059	0.3
Oracle Corp.	3.95%	03/25/2051	USD	26	28,817	0.1
VeriSign, Inc.	2.70%	06/15/2031		14	14,425	0.0
					202,528	0.5
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN						
Southwest Airlines Co. Pass-Through Trust, Series 44378	6.15%	08/01/2022		12	12,068	0.0
					1,749,228	3.9
VERSORGBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
E.ON International Finance BV.	1.25%	10/19/2027	EUR	22	27,817	0.0
Enel Americas SA	4.00%	10/25/2026	USD	35	38,266	0.1
Enel Generacion Chile SA	4.25%	04/15/2024		35	37,445	0.1
NextEra Energy Capital Holdings, Inc.	1.90%	06/15/2028		12	12,159	0.0
					115,687	0.2
					3,372,855	7.4
INFLATIONSgebundene Wertpapiere						
FRANKREICH						
French Republic Government Bond OAT, Series OATE.	0.10%	03/01/2026	EUR	240	310,540	0.7
DEUTSCHLAND						
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	0.10%	04/15/2026		237	309,658	0.7
VEREINIGTE STAATEN						
U.S. Treasury Inflation Index.	0.13%	04/15/2026	USD	223	243,358	0.5
U.S. Treasury Inflation Index.	0.13%	01/15/2031		110	122,454	0.3
					365,812	0.8
					986,010	2.2

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
KANADA					
Canada Housing Trust No. 1	1.80%	12/15/2024	CAD 445	\$ 363,938	0.8%
Canada Housing Trust No. 1	1.95%	12/15/2025	40	32,960	0.1
				<u>396,898</u>	<u>0.9</u>
FRANKREICH					
Societe Nationale SNCF SA	0.63%	04/17/2030	EUR 100	123,517	0.3
JAPAN					
Development Bank of Japan, Inc.	2.30%	03/19/2026	JPY 30,000	300,561	0.6
Development Bank of Japan, Inc., Series G	0.01%	10/15/2024	EUR 100	119,305	0.3
				<u>419,866</u>	<u>0.9</u>
				<u>940,281</u>	<u>2.1</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB SICAV I - Low Volatility Equity Portfolio - Class S1			21,785	907,979	2.0
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	02/01/2042	USD 5,879	6,412	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	11/01/2042	65	71,349	0.1
Federal National Mortgage Association, Series 2012	3.50%	01/01/2043	10,516	11,467	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2013	3.50%	04/01/2043	40	43,619	0.1
Government National Mortgage Association, Series 2021	3.00%	09/01/2051	162,000	169,353	0.4
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2020	3.50%	09/01/2051	146,831	155,320	0.4
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021	2.00%	09/01/2051	64,907	65,840	0.2
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021	2.50%	09/01/2051	234,000	243,104	0.5
				<u>766,464</u>	<u>1.7</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
FRANKREICH					
Dexia Credit Local SA	0.50%	01/17/2025	EUR 200	242,882	0.5
DEUTSCHLAND					
Kreditanstalt fuer Wiederaufbau	0.00%	06/15/2029	53	64,086	0.2
MEXIKO					
Mexico Government International Bond	3.38%	02/23/2031	110	151,662	0.3
PANAMA					
Panama Government International Bond	8.88%	09/30/2027	USD 25	34,513	0.1
PERU					
Peruvian Government International Bond	2.39%	01/23/2026	60	62,167	0.1
				<u>555,310</u>	<u>1.2</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Eagle RE Ltd, Series 2018-1, Class M1	1.78%	11/25/2028	51,619	51,652	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Series 2021-DNA3, Class M2(b)	2.15%	10/25/2033	17	17,395	0.0
Series 2021-DNA5, Class M2(b)	1.70%	01/25/2034	13	13,293	0.0
Federal National Mortgage Association					
Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C03, Class 2M2(b)	2.98%	07/25/2024	7	6,863	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(b)	4.98%	11/25/2024	27	27,766	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(b)	5.08%	11/25/2024	9	8,882	0.0
Series 2015-C03, Class 2M2(b)	5.08%	07/25/2025	1	1,311	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(b)	5.78%	04/25/2028	9	9,487	0.0
Series 2016-C01, Class 1M2(b)	6.83%	08/25/2028	17	17,909	0.1
Series 2016-C02, Class 1M2(b)	6.08%	09/25/2028	43	44,598	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(b)	5.38%	10/25/2028	24	24,748	0.1
Series 2016-C04, Class 1M2(b)	4.33%	01/25/2029	39	40,643	0.1
Series 2016-C05, Class 2M2(b)	4.53%	01/25/2029	43	44,421	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(b)	4.33%	04/25/2029	91	93,819	0.2
Series 2017-C01, Class 1M2(b)	3.63%	07/25/2029	50	51,723	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-1R, Class A	2.08%	03/27/2024	37,184	37,131	0.1
				<u>491,641</u>	<u>1.1</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN					
KANADA					
Province of British Columbia Canada	4.25%	11/27/2024	AUD 130	106,106	0.2
Province of Ontario Canada	6.50%	03/08/2029	CAD 115	122,630	0.3
				<u>228,736</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
CHINA					
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	1.25%	05/19/2022	EUR 100	\$ 119,130	0.3%
MEXIKO					
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	USD 25	21,963	0.0
				141,093	0.3
GEDECKTE ANLEIHEN					
DNB Boligkredit AS	0.63%	06/19/2025	EUR 100	122,712	0.3
GEMEINDEVERWALTUNG – REGIONALANLEIHEN					
JAPAN					
Japan Finance Organization for Municipalities, Series G	0.01%	02/02/2028	100	119,105	0.3
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-CBX, Class C	5.08%	06/15/2045	USD 55	52,725	0.1
ABS-ANLEIHEN					
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Flagship Credit Auto Trust, Series 2018-3, Class D	4.15%	12/16/2024	39	40,897	0.1
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
DIENSTLEISTUNGEN					
IHS Markit Ltd.	4.25%	05/01/2029	9	10,395	0.0
IHS Markit Ltd.	4.75%	08/01/2028	4	4,733	0.0
				15,128	0.0
				42,490,864	93.8
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
Keyera Corp.			325	7,826	0.0
Gesamtanlagen					
(Kosten \$35,627,040)				\$ 42,498,690	93.8%
Termineinlagen					
ANZ, London(c)	(0.13)%	–		601	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(c)	0.01 %	–		3,991,333	8.8
BNP Paribas, Paris(c)	(1.38)%	–		943	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	(0.59)%	–		1,172	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	(0.13)%	–		1,526	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	(0.08)%	–		547	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.00 %	–		1,177	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	0.01 %	–		3,810	0.0
BNP Paribas, Paris(c)	4.00 %	–		645	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(c)	(1.38)%	–		564	0.0
Deutsche Bank, Frankfurt(c)	(0.78)%	–		577	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(c)	0.00 %	–		2,002	0.0
HSBC Bank PLC, London(c)	0.00 %	–		2,339	0.0
SEB, Stockholm(c)	(0.26)%	–		8,349	0.0
SEB, Stockholm(c)	0.01 %	–		48,670	0.1
Sumitomo, London(c)	(0.28)%	–		17,246	0.0
Sumitomo, London(c)	0.00 %	–		587	0.0
Sumitomo, Tokyo(c)	(0.78)%	–		208,022	0.5
Sumitomo, Tokyo(c)	0.01 %	–		475,476	1.1
Termineinlagen insgesamt				4,765,586	10.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(1,942,926)	(4.3)
Nettovermögen				\$ 45,321,350	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
10 Yr Australian Bond Futures	09/15/2021	2	\$ 209,062	\$ 213,333	\$ 4,271
10 Yr Canadian Bond Futures	12/20/2021	3	346,689	347,474	785
10 Yr Mini Japan Government Bond Futures	09/10/2021	13	1,801,063	1,798,009	(3,054)
EURO STOXX 50 Index Futures	09/17/2021	4	197,172	197,533	361
Euro-Bund Futures	09/08/2021	1	209,217	207,163	(2,055)
Hang Seng Index Futures	09/29/2021	2	327,381	330,967	3,586
Korea 3 Yr Bond Futures	09/17/2021	8	759,222	762,637	3,415
Korea 10 Yr Bond Futures	09/17/2021	3	325,344	331,243	5,899
Long Gilt Futures	12/29/2021	2	353,364	352,622	(742)
OMXS30 Index Futures	09/17/2021	4	110,146	109,178	(968)
S&P 500 E-Mini Futures	09/17/2021	3	662,285	678,075	15,790
TOPIX Index Futures	09/09/2021	2	354,543	356,810	2,267
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	12/31/2021	2	440,359	440,656	297
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/21/2021	10	1,330,391	1,334,531	4,141
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/21/2021	1	196,617	197,281	664
Short					
Euro-BOBL Futures	09/08/2021	10	1,583,303	1,593,658	(10,355)
Euro-Schatz Futures	09/08/2021	4	529,732	530,298	(567)
MSCI Emerging Markets Index Futures	09/17/2021	6	393,462	389,760	3,702
MSCI Singapore IX ETS Futures	09/29/2021	3	79,776	78,267	1,509
S&P/TSX 60 IX Futures	09/16/2021	1	189,371	194,967	(5,596)
SPI 200 Futures	09/16/2021	3	400,337	408,167	(7,830)
U.S. 10 Yr Ultra Futures	12/21/2021	4	589,109	592,063	(2,953)
					\$ 12,567
				Wertsteigerung	\$ 46,687
				Wertminderung	\$ (34,120)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA	USD 27	RUB 2,041	09/30/2021	\$ 421
BNP Paribas SA	CNH 503	USD 77	09/16/2021	(449)
Brown Brothers Harriman & Co.	CNH 233	USD 36	09/16/2021	(193)
Brown Brothers Harriman & Co.	PLN 210	USD 55	09/17/2021	422
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 7	PLN 26	09/17/2021	(41)
Brown Brothers Harriman & Co.	CAD 669	USD 532	09/24/2021	2,149
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 785	CAD 984	09/24/2021	(5,743)
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS 276	USD 85	09/30/2021	(1,496)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 39	ILS 128	09/30/2021	532
Brown Brothers Harriman & Co.	THB 1,102	USD 34	10/07/2021	(468)
Brown Brothers Harriman & Co.	NOK 1,633	USD 185	10/13/2021	(2,670)
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK 612	USD 70	10/13/2021	(534)
Brown Brothers Harriman & Co.	SEK 187	USD 22	10/13/2021	19
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 353	NOK 3,107	10/13/2021	4,202
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 144	SEK 1,240	10/13/2021	(183)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 300	SEK 2,595	10/13/2021	1,269
Brown Brothers Harriman & Co.	NZD 98	USD 68	10/15/2021	(835)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 139	NZD 199	10/15/2021	1,664
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF 38	USD 42	10/28/2021	(11)
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF 234	USD 259	10/28/2021	3,197
Brown Brothers Harriman & Co.	MXN 5,625	USD 275	10/28/2021	(3,048)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 21	CHF 19	10/28/2021	(282)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 305	USD 360	11/08/2021	(1,055)
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 930	USD 1,107	11/08/2021	7,630
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 735	EUR 625	11/08/2021	3,962
Brown Brothers Harriman & Co.	AUD 983	USD 709	11/09/2021	(11,034)
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 424	USD 583	11/10/2021	(738)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 185	GD 24	11/10/2021	216
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 17,132	USD 156	11/17/2021	231
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 298	JPY 32,617	11/17/2021	(1,522)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 3,782	EUR 3,219	10/01/2021	21,391
Citibank, NA	CNH 1,553	USD 238	09/16/2021	(1,857)
Citibank, NA	USD 78	CNH 506	09/16/2021	597
Citibank, NA	JPY 276,026	USD 2,521	11/17/2021	10,614
Deutsche Bank AG	USD 6	CNH 36	09/16/2021	38
HSBC Bank USA	USD 16	CNH 104	09/16/2021	142
Morgan Stanley Capital Services LLC	MYR 278	USD 67	09/23/2021	349

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CAD 755	USD 606	09/24/2021	\$ 7,387
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW 149,763	USD 131	10/28/2021	2,173
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR 5,152	USD 6,122	11/08/2021	31,224
Royal Bank of Scotland PLC	COP 458,323	USD 118	09/16/2021	(3,026)
				<u>\$ 64,644</u>
			Wertsteigerung	\$ 99,829
			Wertminderung	\$ (35,185)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	EUR 100	09/30/2050	0.122%	6 Month EURIBOR	\$ 6,180
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	100	11/10/2050	0.022%	6 Month EURIBOR	8,814
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	100	11/10/2050	6 Month EURIBOR	(0.043)%	(11,805)
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	100	09/30/2050	6 Month EURIBOR	(0.017)%	(10,884)
Credit Suisse Securities (USA) LLC/(LCH Group)	CAD 860	05/22/2024	3 Monats CDOR	1.980%	18,424
Insgesamt					<u>\$ 10,729</u>
				Wertsteigerung	\$ 33,418
				Wertminderung	\$ (22,689)

TOTAL-RETURN-SWAPS

Kontrahent & Referenz-Obligation	Anzahl der Anteile oder Einheiten	Bezahler/ Erhaltener Zinssatz	Nominal- betrag (000)	Fälligkeits- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation zahlen					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Bloomberg Commodity Index	5,960	0.12%	USD 1,464	09/15/2021	\$ 48,307
JPMorgan Chase Bank, NA					
FTSE EPRA/NAREIT Developed Real Estate Index	52	3 Month LIBOR Plus 0.39%	334	04/18/2022	6,881
UBS AG					
FTSE EPRA/NAREIT Developed Real Estate Index	181	3 Month LIBOR Plus 0.23%	1,179	09/15/2021	8,058
Gesamtrendite auf Referenz-Obligation erhalten					
Morgan Stanley Capital Services LLC					
Swiss Market Index Futures	10	0.00%	CHF 124	09/17/2021	(391)
Insgesamt					<u>\$ 62,855</u>
				Wertsteigerung	\$ 63,246
				Wertminderung	\$ (391)
Swaps insgesamt					<u>\$ 73,584</u>

- (a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (b) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. August 2021.
- (c) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
 CAD – Canadian Dollar
 CHF – Swiss Franc
 CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
 CNY – Chinese Yuan Renminbi
 COP – Colombian Peso
 EUR – Euro
 GBP – Great British Pound
 ILS – Israeli Shekel
 JPY – Japanese Yen

KRW – South Korean Won
MXN – Mexican Peso
MYR – Malaysian Ringgit
NOK – Norwegian Krone
NZD – New Zealand Dollar
PLN – Polish Zloty
RUB – Russian Ruble
SEK – Swedish Krona
SGD – Singapore Dollar
THB – Thailand Baht
USD – United States Dollar

Glossar:

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

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Calix, Inc.	25,705	\$ 1,197,857	0.9%
Lumentum Holdings, Inc.	16,972	1,470,457	1.0
Motorola Solutions, Inc.	6,133	1,497,746	1.1
Telefonaktiebolaget LM Ericsson - Class B	45,396	537,715	0.4
		<u>4,703,775</u>	<u>3.4</u>
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Avnet, Inc.	6,551	265,044	0.2
Flex Ltd.	81,344	1,511,363	1.1
		<u>1,776,407</u>	<u>1.3</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
21 Vianet Group, Inc. (ADR)	6,406	126,778	0.1
Adyen NV	413	1,334,907	1.0
Amdocs Ltd.	4,172	321,334	0.2
Network International Holdings PLC	84,807	456,125	0.3
Square, Inc. - Class A	3,638	975,138	0.7
Twilio, Inc. - Class A	1,737	619,943	0.5
Visa, Inc. - Class A	4,073	933,115	0.7
		<u>4,767,340</u>	<u>3.5</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Cree, Inc.	8,104	688,695	0.5
Infineon Technologies AG	28,524	1,214,504	0.9
NXP Semiconductors NV	8,959	1,927,504	1.4
ON Semiconductor Corp.	10,153	450,401	0.3
		<u>4,281,104</u>	<u>3.1</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	1,877	1,245,556	0.9
Avast PLC	35,913	295,361	0.2
Citrix Systems, Inc.	4,277	439,981	0.3
Coinbase Global, Inc.	2,455	635,831	0.5
CommVault Systems, Inc.	8,804	712,828	0.5
Dassault Systemes SE	24,809	1,416,971	1.1
Microsoft Corp.	12,382	3,737,845	2.8
NortonLifeLock, Inc.	15,732	417,850	0.3
Oracle Corp.	20,367	1,815,353	1.3
Zendesk, Inc.	6,675	825,067	0.6
		<u>11,542,643</u>	<u>8.5</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	20,201	3,067,002	2.3
NCR Corp.	7,040	299,076	0.2
Samsung Electronics Co., Ltd.	7,787	514,115	0.4
Western Digital Corp.	13,342	843,232	0.6
		<u>4,723,425</u>	<u>3.5</u>
		<u>31,794,694</u>	<u>23.3</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	4,847	663,023	0.5
Hexcel Corp.	20,453	1,159,877	0.8
		<u>1,822,900</u>	<u>1.3</u>
BAUPRODUKTE			
Trex Co., Inc.	13,389	1,469,533	1.1
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
ADT, Inc.	78,629	673,067	0.5
Herman Miller, Inc.	9,978	419,395	0.3
Tetra Tech, Inc.	5,859	842,757	0.6
TOMRA Systems ASA	22,160	1,361,882	1.0
Waste Management, Inc.	10,818	1,677,910	1.3
		<u>4,975,011</u>	<u>3.7</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
AECOM	9,058	593,830	0.4
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Prismian SpA	8,163	307,326	0.2
Regal Beloit Corp.	5,441	813,036	0.6
Rockwell Automation, Inc.	4,619	1,503,206	1.1

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Schneider Electric SE	8,394	\$ 1,499,656	1.1%
Vestas Wind Systems A/S	30,422	1,228,318	0.9
		<u>5,351,542</u>	<u>3.9</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
Hitachi Ltd.	6,806	376,124	0.3
MASCHINEN			
Alstom SA	9,101	391,271	0.3
Oshkosh Corp.	3,831	438,978	0.3
SMC Corp.	1,603	1,025,729	0.8
Xylem, Inc./NY	10,207	1,391,313	1.0
		<u>3,247,291</u>	<u>2.4</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Recruit Holdings Co., Ltd.	23,664	1,393,409	1.0
Robert Half International, Inc.	10,783	1,115,007	0.8
		<u>2,508,416</u>	<u>1.8</u>
STRASSE UND SCHIENE			
Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	20,278	1,053,021	0.8
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Air Lease Corp.	14,551	578,270	0.4
		<u>21,975,938</u>	<u>16.1</u>
GESUNDHEITSWESEN			
BIOTECHNOLOGIE			
Abcam PLC	42,909	910,848	0.6
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Alcon, Inc.	12,779	1,052,471	0.8
Danaher Corp.	5,305	1,719,788	1.2
Koninklijke Philips NV	26,773	1,233,795	0.9
Medtronic PLC	7,723	1,030,873	0.7
Smith & Nephew PLC	33,559	642,618	0.5
STERIS PLC	5,620	1,208,349	0.9
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	5,221	785,434	0.6
		<u>7,673,328</u>	<u>5.6</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Apollo Hospitals Enterprise Ltd.	28,183	1,917,533	1.4
Centene Corp.	8,353	526,075	0.4
Laboratory Corp. of America Holdings	6,693	2,030,518	1.5
UnitedHealth Group, Inc.	2,285	951,232	0.7
		<u>5,425,358</u>	<u>4.0</u>
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Change Healthcare, Inc.	11,772	256,983	0.2
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	2,102	1,691,991	1.2
Bruker Corp.	13,273	1,172,104	0.9
Gerresheimer AG (a)	8,567	910,065	0.7
		<u>3,774,160</u>	<u>2.8</u>
PHARMAZEUTIKA			
GlaxoSmithKline PLC	22,097	444,504	0.3
Johnson & Johnson	1,761	304,927	0.2
Roche Holding AG	2,857	1,147,144	0.9
Sanofi	5,086	527,113	0.4
		<u>2,423,688</u>	<u>1.8</u>
		<u>20,464,365</u>	<u>15.0</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	45,003	371,782	0.3
Bank of America Corp.	28,645	1,195,940	0.9
Bank of Ireland Group PLC	77,774	486,452	0.3
Bank Polska Kasa Opieki SA	18,652	521,587	0.4
Erste Group Bank AG	36,573	1,460,350	1.1
Grupo Financiero Banorte SAB de CV - Class O	75,529	498,551	0.4
HDFC Bank Ltd.	57,071	1,230,490	0.9
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	89,758	257,108	0.2
KB Financial Group, Inc.	9,234	420,056	0.3
Nordea Bank Abp	66,158	777,027	0.6
SVB Financial Group	2,986	1,670,696	1.2
Wells Fargo & Co.	24,957	1,140,518	0.8
		<u>10,030,557</u>	<u>7.4</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KAPITALMÄRKTE			
Credit Suisse Group AG (REG)	22,251	\$ 235,714	0.2%
Morgan Stanley	4,927	514,494	0.4
MSCI, Inc. - Class A	2,768	1,756,813	1.3
Partners Group Holding AG	878	1,556,126	1.1
		<u>4,063,147</u>	<u>3.0</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
Synchrony Financial	7,693	382,743	0.3
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd.	68,878	822,458	0.6
Everest Re Group Ltd.	1,367	361,988	0.2
Intact Financial Corp.	0*	9	0.0
Suncorp Group Ltd.	70,198	638,736	0.5
		<u>1,823,191</u>	<u>1.3</u>
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG			
BankUnited, Inc.	9,995	420,101	0.3
		<u>16,719,739</u>	<u>12.3</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Aptiv PLC	8,633	1,313,884	1.0
Faurecia SE	12,162	587,560	0.4
Toyo Tire Corp.	19,307	342,971	0.2
		<u>2,244,415</u>	<u>1.6</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Stellantis NV	39,237	786,528	0.6
Suzuki Motor Corp.	5,750	248,456	0.2
		<u>1,034,984</u>	<u>0.8</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	11,642	386,391	0.3
Entain PLC	32,506	863,865	0.6
Restaurant Brands International, Inc.	10,396	667,532	0.5
		<u>1,917,788</u>	<u>1.4</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
PulteGroup, Inc.	16,477	887,438	0.7
Sony Group Corp.	4,237	438,056	0.3
TopBuild Corp.	5,673	1,241,175	0.9
		<u>2,566,669</u>	<u>1.9</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	8,157	170,812	0.1
eBay, Inc.	5,876	450,892	0.3
MercadoLibre, Inc.	323	602,434	0.5
		<u>1,224,138</u>	<u>0.9</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	453	701,127	0.5
Foot Locker, Inc.	5,512	312,499	0.2
		<u>1,013,626</u>	<u>0.7</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Carter's, Inc.	4,328	443,118	0.3
NIKE, Inc. - Class B	8,717	1,436,034	1.1
Pandora A/S	2,755	330,170	0.3
Tapestry, Inc.	18,013	726,274	0.5
		<u>2,935,596</u>	<u>2.2</u>
		<u>12,937,216</u>	<u>9.5</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Charter Communications, Inc. - Class A	1,059	864,988	0.6
Comcast Corp. - Class A	25,205	1,529,422	1.1
Deutsche Telekom AG (REG)	38,421	816,953	0.6
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	13,349	355,655	0.3
		<u>3,567,018</u>	<u>2.6</u>
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	2,319	336,707	0.3
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class A	424	1,228,029	0.9
Facebook, Inc. - Class A	4,242	1,609,364	1.2
Z Holdings Corp.	48,910	318,027	0.2
		<u>3,155,420</u>	<u>2.3</u>
		<u>7,059,145</u>	<u>5.2</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
EDP - Energias de Portugal SA	182,398	\$ 1,001,281	0.7%
Enel SpA	116,525	1,061,594	0.8
NextEra Energy, Inc.	18,379	1,543,690	1.1
Orsted AS	3,220	511,992	0.4
		<u>4,118,557</u>	<u>3.0</u>
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	81,103	492,198	0.4
Kunlun Energy Co., Ltd.	540,954	572,135	0.4
		<u>1,064,333</u>	<u>0.8</u>
WASSERVERSORGER			
American Water Works Co., Inc.	4,600	838,333	0.6
		<u>6,021,223</u>	<u>4.4</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Carlsberg AS - Class B	1,755	306,456	0.2
Coca-Cola Co. (The)	15,936	897,361	0.7
Molson Coors Beverage Co. - Class B	5,221	248,133	0.2
		<u>1,451,950</u>	<u>1.1</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	12,834	432,982	0.3
Walmart, Inc.	3,627	537,222	0.4
		<u>970,204</u>	<u>0.7</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Hain Celestial Group, Inc. (The)	17,085	639,139	0.5
Nichirei Corp.	14,506	369,844	0.3
Nomad Foods Ltd.	8,650	228,263	0.1
Salmar ASA	2,870	192,340	0.1
WH Group Ltd.	286,886	248,835	0.2
		<u>1,678,421</u>	<u>1.2</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
Procter & Gamble Co. (The)	5,002	712,282	0.5
TABAK			
Philip Morris International, Inc.	8,021	826,173	0.6
		<u>5,639,030</u>	<u>4.1</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Chr Hansen Holding A/S	11,774	1,086,475	0.8
Koninklijke DSM NV	6,086	1,295,783	1.0
LyondellBasell Industries NV - Class A	4,851	486,835	0.4
Tosoh Corp.	39,085	709,415	0.5
Trinseo SA	3,887	201,831	0.1
		<u>3,780,339</u>	<u>2.8</u>
METALL UND BERGBAU			
Agnico Eagle Mines Ltd.	4,417	254,186	0.2
Northern Star Resources Ltd.	30,724	218,565	0.1
Reliance Steel & Aluminum Co.	1,963	294,530	0.2
South32 Ltd.	239,120	544,966	0.4
		<u>1,312,247</u>	<u>0.9</u>
		<u>5,092,586</u>	<u>3.7</u>
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
Americold Realty Trust	14,214	522,216	0.4
Medical Properties Trust, Inc.	11,588	237,317	0.2
MGM Growth Properties LLC - Class A	8,218	340,713	0.2
Mid-America Apartment Communities, Inc.	2,295	441,531	0.3
Omega Healthcare Investors, Inc.	3,744	125,529	0.1
		<u>1,667,306</u>	<u>1.2</u>
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Aroundtown SA	49,953	382,777	0.3
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	606,858	407,944	0.3
Vonovia SE	4,270	288,298	0.2
		<u>1,079,019</u>	<u>0.8</u>
		<u>2,746,325</u>	<u>2.0</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
ENEOS Holdings, Inc. (a)			87,814	\$ 339,395	0.3%
Repsol SA			32,802	376,407	0.3
Royal Dutch Shell PLC - Class A			40,443	804,529	0.6
Royal Dutch Shell PLC - Class A (London)			2,605	51,633	0.0
				<u>1,571,964</u>	<u>1.2</u>
				132,022,225	96.8
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
VERSORGUNG					
STROMVERSORGBETRIEBE					
Power Grid Corp. of India Ltd.			98,864	237,098	0.2
Gesamtanlagen				<u>\$ 132,259,323</u>	<u>97.0%</u>
(Kosten \$105,723,284)					
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	(0.13)%	–		6,707	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(1.38)%	–		6,863	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.59)%	–		13,170	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.08)%	–		14,131	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.01 %	–		6,202	0.0
Citibank, New York(b)	0.01 %	–		1,473,789	1.1
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.38)%	–		6,322	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	–		13,397	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(b)	(0.78)%	–		36,850	0.1
JPMorgan Chase, New York(b)	0.01 %	–		1,447,918	1.1
SEB, Stockholm(b)	(0.26)%	–		13,643	0.0
Sumitomo, London(b)	(0.28)%	–		6,622	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	–		2,203	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.78)%	–		769	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.28)%	–		6,764	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	0.00 %	–		13,493	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>3,068,843</u>	<u>2.3</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>1,012,117</u>	<u>0.7</u>
Nettovermögen				<u>\$ 136,340,283</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	USD 182	ILS 592	09/14/2021	\$ 3,011
Bank of America, NA	AUD 501	USD 388	09/16/2021	20,746
Bank of America, NA	USD 256	EUR 216	09/16/2021	(1,223)
Bank of America, NA	USD 102	CAD 128	09/24/2021	(426)
Bank of America, NA	USD 225	RUB 16,790	09/30/2021	3,461
Bank of America, NA	INR 109,799	USD 1,456	10/08/2021	(42,799)
Barclays Bank PLC	INR 9,169	USD 122	10/08/2021	(3,437)
BNP Paribas SA	USD 934	KRW 1,072,752	10/28/2021	(9,197)
BNP Paribas SA	HKD 1,786	USD 229	11/10/2021	(491)
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS 885	USD 273	09/14/2021	(3,040)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 28	ILS 92	09/14/2021	769
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 430	USD 521	09/16/2021	12,776
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 6,761	EUR 5,755	10/01/2021	37,930
Citibank, NA	USD 1,731	CNH 11,269	09/16/2021	13,296
Citibank, NA	USD 163	EUR 138	09/16/2021	(176)
Citibank, NA	CHF 582	USD 645	10/28/2021	8,704
Citibank, NA	EUR 140	USD 166	11/08/2021	815
Citibank, NA	USD 1,051	AUD 1,458	11/09/2021	16,266
Citibank, NA	USD 1,465	JPY 160,415	11/17/2021	(6,222)
Credit Suisse International	EUR 49	USD 58	09/16/2021	54
Deutsche Bank AG	ILS 870	USD 268	09/14/2021	(3,034)
Goldman Sachs Bank USA	USD 321	BRL 1,666	09/02/2021	1,319
Goldman Sachs Bank USA	PLN 1,273	USD 337	09/16/2021	4,580
Goldman Sachs Bank USA	USD 272	CNH 1,776	09/16/2021	2,968
Goldman Sachs Bank USA	USD 166	ZAR 2,310	09/16/2021	(7,335)
Goldman Sachs Bank USA	EUR 142	USD 166	11/08/2021	(1,063)
Goldman Sachs Bank USA	USD 1,333	GBP 971	11/10/2021	1,493
Goldman Sachs Bank USA	CNH 1,401	USD 214	12/16/2021	(1,152)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)		Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JPMorgan Chase Bank, NA	EUR	1,469	USD	1,784	09/16/2021	\$ 49,288
JPMorgan Chase Bank, NA	USD	271	CNH	1,754	09/16/2021	757
Morgan Stanley Capital Services LLC	BRL	1,666	USD	318	09/02/2021	(4,254)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	47	ILS	154	09/14/2021	1,210
Morgan Stanley Capital Services LLC	CNH	10,664	USD	1,641	09/16/2021	(8,845)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	688	USD	823	09/16/2021	10,131
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	343	CNH	2,231	09/16/2021	1,850
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	168	EUR	142	09/16/2021	(296)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	1,424	CAD	1,774	09/24/2021	(17,352)
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	317	BRL	1,666	10/04/2021	4,165
Morgan Stanley Capital Services LLC	NOK	9,555	USD	1,091	10/13/2021	(7,744)
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW	779,577	USD	684	10/28/2021	11,310
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	102	JPY	11,233	11/17/2021	65
Royal Bank of Scotland PLC	EUR	191	USD	226	09/16/2021	291
Royal Bank of Scotland PLC	CHF	99	USD	108	10/28/2021	49
Standard Chartered Bank	INR	29,816	USD	399	10/08/2021	(8,123)
Standard Chartered Bank	USD	993	TWD	27,667	10/21/2021	11,730
State Street Bank & Trust Co.	EUR	154	USD	187	09/16/2021	5,243
UBS AG	EUR	4,662	USD	5,542	11/08/2021	29,785
UBS AG	EUR	195	USD	229	11/08/2021	(928)
						\$ 126,925
					Wertsteigerung	\$ 254,062
					Wertminderung	\$ (127,137)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

* Anteilsbetrag weniger als 0.50.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

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

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			
Avnet, Inc.	90,859	\$ 3,676,165	0.4%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
21 Vianet Group, Inc. (ADR)	88,854	1,758,417	0.2
Amdocs Ltd.	57,859	4,456,914	0.5
		<u>6,215,331</u>	<u>0.7</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
NXP Semiconductors NV	45,136	9,710,066	1.0
ON Semiconductor Corp.	140,827	6,247,072	0.7
		<u>15,957,138</u>	<u>1.7</u>
SOFTWARE			
Avast PLC	498,120	4,096,663	0.4
Citrix Systems, Inc.	59,323	6,102,551	0.7
CommVault Systems, Inc.	122,106	9,886,954	1.1
Microsoft Corp.	109,496	33,054,531	3.5
NortonLifeLock, Inc.	218,208	5,795,596	0.6
Oracle Corp.	282,498	25,179,005	2.7
		<u>84,115,300</u>	<u>9.0</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	166,233	25,239,150	2.7
NCR Corp.	97,651	4,148,197	0.4
Samsung Electronics Co., Ltd.	108,013	7,130,796	0.8
Western Digital Corp.	185,058	11,695,648	1.3
		<u>48,213,791</u>	<u>5.2</u>
		<u>158,177,725</u>	<u>17.0</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
Faurecia SE	168,689	8,149,471	0.9
Toyo Tire Corp.	267,793	4,757,021	0.5
		<u>12,906,492</u>	<u>1.4</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Stellantis NV	544,215	10,909,171	1.2
Suzuki Motor Corp.	79,750	3,446,088	0.3
		<u>14,355,259</u>	<u>1.5</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Aristocrat Leisure Ltd.	161,468	5,359,251	0.6
Entain PLC	450,854	11,981,834	1.3
Restaurant Brands International, Inc.	144,194	9,258,691	1.0
		<u>26,599,776</u>	<u>2.9</u>
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
PulteGroup, Inc.	228,533	12,308,800	1.3
Sony Group Corp.	58,763	6,075,853	0.7
		<u>18,384,653</u>	<u>2.0</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	113,143	2,369,161	0.2
eBay, Inc.	81,494	6,253,882	0.7
		<u>8,623,043</u>	<u>0.9</u>
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
AutoZone, Inc.	6,277	9,724,652	1.0
Foot Locker, Inc.	76,458	4,334,380	0.5
		<u>14,059,032</u>	<u>1.5</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Carter's, Inc.	60,032	6,146,059	0.6
Pandora A/S	38,205	4,579,466	0.5
Tapestry, Inc.	249,837	10,073,439	1.1
		<u>20,798,964</u>	<u>2.2</u>
		<u>115,727,219</u>	<u>12.4</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Leumi Le-Israel BM	624,197	\$ 5,156,625	0.6%
Bank of America Corp.	397,311	16,587,723	1.8
Bank of Ireland Group PLC	1,078,728	6,747,107	0.7
Bank Polska Kasa Opieki SA	258,708	7,234,434	0.8
Grupo Financiero Banorte SAB de CV - Class O	1,047,591	6,914,914	0.7
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	1,244,942	3,566,103	0.4
KB Financial Group, Inc.	128,076	5,826,185	0.6
Nordea Bank Abp	917,612	10,777,394	1.2
Wells Fargo & Co.	346,149	15,819,026	1.7
		<u>78,629,511</u>	<u>8.5</u>
KAPITALMÄRKTE			
Credit Suisse Group AG (REG)	308,619	3,269,363	0.3
Morgan Stanley	68,333	7,136,048	0.8
		<u>10,405,411</u>	<u>1.1</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
Synchrony Financial	106,707	5,308,657	0.6
VERSICHERUNGEN			
Everest Re Group Ltd.	18,953	5,020,780	0.5
Intact Financial Corp.	1	127	0.0
Suncorp Group Ltd.	973,652	8,859,289	1.0
		<u>13,880,196</u>	<u>1.5</u>
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG			
BankUnited, Inc.	138,635	5,826,818	0.6
		<u>114,050,593</u>	<u>12.3</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Airbus SE	67,225	9,196,148	1.0
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
ADT, Inc.	1,090,591	9,335,457	1.0
Herman Miller, Inc.	138,402	5,817,017	0.6
		<u>15,152,474</u>	<u>1.6</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
AECOM	125,632	8,236,446	0.9
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Prysmian SpA	113,217	4,262,625	0.4
Regal Beloit Corp.	75,471	11,276,835	1.2
Schneider Electric SE (Paris)	34,586	6,179,430	0.7
		<u>21,718,890</u>	<u>2.3</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
Hitachi Ltd.	94,394	5,216,848	0.5
MASCHINEN			
Alstom SA	126,228	5,426,947	0.6
Oshkosh Corp.	53,139	6,088,644	0.6
		<u>11,515,591</u>	<u>1.2</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Robert Half International, Inc.	149,567	15,465,183	1.7
STRASSE UND SCHIENE			
Knight-Swift Transportation Holdings, Inc.	281,252	14,605,432	1.6
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Air Lease Corp.	201,828	8,020,631	0.9
		<u>109,127,643</u>	<u>11.7</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Charter Communications, Inc. - Class A	14,691	11,997,407	1.3
Comcast Corp. - Class A	349,590	21,213,138	2.3
Deutsche Telekom AG (REG)	532,899	11,331,169	1.2
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	185,151	4,932,940	0.5
		<u>49,474,654</u>	<u>5.3</u>
UNTERHALTUNG			
Electronic Arts, Inc.	32,161	4,670,134	0.5

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Alphabet, Inc. - Class A	5,886	\$ 17,032,796	1.8%
Facebook, Inc. - Class A	58,838	22,321,927	2.4
Z Holdings Corp.	678,390	4,411,049	0.5
		<u>43,765,772</u>	<u>4.7</u>
		<u>97,910,560</u>	<u>10.5</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Medtronic PLC	107,119	14,298,238	1.5
Smith & Nephew PLC	465,461	8,913,131	1.0
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	72,409	10,893,999	1.2
		<u>34,105,368</u>	<u>3.7</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Centene Corp.	115,857	7,296,671	0.8
UnitedHealth Group, Inc.	31,695	13,193,622	1.4
		<u>20,490,293</u>	<u>2.2</u>
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Change Healthcare, Inc.	163,278	3,564,359	0.4
PHARMAZEUTIKA			
GlaxoSmithKline PLC	306,493	6,165,284	0.7
Johnson & Johnson	24,429	4,229,348	0.4
Roche Holding AG	39,623	15,910,920	1.7
Sanofi	70,544	7,311,075	0.8
		<u>33,616,627</u>	<u>3.6</u>
		<u>91,776,647</u>	<u>9.9</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Carlsberg AS - Class B	24,335	4,250,557	0.5
Coca-Cola Co. (The)	221,034	12,446,420	1.3
Molson Coors Beverage Co. - Class B	72,409	3,441,620	0.4
		<u>20,138,597</u>	<u>2.2</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Koninklijke Ahold Delhaize NV	178,006	6,005,471	0.6
Walmart, Inc.	50,313	7,451,291	0.8
		<u>13,456,762</u>	<u>1.4</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Hain Celestial Group, Inc. (The)	236,965	8,864,872	1.0
Nichirei Corp.	201,194	5,129,747	0.5
Nomad Foods Ltd.	119,970	3,166,019	0.3
Salmar ASA	39,800	2,667,763	0.3
WH Group Ltd.	3,979,114	3,451,349	0.4
		<u>23,279,750</u>	<u>2.5</u>
TABAK			
Philip Morris International, Inc.	111,253	11,459,049	1.2
		<u>68,334,158</u>	<u>7.3</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGBETRIEBE			
EDP - Energias de Portugal SA	2,529,864	13,887,801	1.5
Enel SpA	1,616,205	14,724,339	1.6
NextEra Energy, Inc.	73,753	6,194,480	0.6
		<u>34,806,620</u>	<u>3.7</u>
GASVERSORGBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	1,124,897	6,826,807	0.7
Kunlun Energy Co., Ltd.	7,503,046	7,935,530	0.9
		<u>14,762,337</u>	<u>1.6</u>
		<u>49,568,957</u>	<u>5.3</u>
IMMOBILIEN			
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)			
Americold Realty Trust	197,146	7,243,150	0.8
Medical Properties Trust, Inc.	160,722	3,291,592	0.3
MGM Growth Properties LLC - Class A	113,982	4,725,699	0.5
Mid-America Apartment Communities, Inc.	31,835	6,124,057	0.7
Omega Healthcare Investors, Inc.	51,926	1,741,086	0.2
		<u>23,125,584</u>	<u>2.5</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG					
Aroundtown SA			692,857	\$ 5,309,133	0.6%
CIFI Holdings Group Co., Ltd.			8,417,142	5,658,193	0.6
Vonovia SE			59,231	3,998,709	0.4
				<u>14,966,035</u>	<u>1.6</u>
				<u>38,091,619</u>	<u>4.1</u>
GRUNDSTOFFE					
CHEMIKALIEN					
LyondellBasell Industries NV - Class A			67,289	6,752,414	0.7
Tosoh Corp.			542,115	9,839,610	1.1
Trinseo SA			53,907	2,799,411	0.3
				<u>19,391,435</u>	<u>2.1</u>
METALL UND BERGBAU					
Agnico Eagle Mines Ltd.			61,268	3,525,571	0.4
Northern Star Resources Ltd.			426,136	3,031,508	0.3
Reliance Steel & Aluminum Co.			27,227	4,085,138	0.4
South32 Ltd.			3,316,604	7,558,690	0.8
				<u>18,200,907</u>	<u>1.9</u>
				<u>37,592,342</u>	<u>4.0</u>
ENERGIE					
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE					
ENEOS Holdings, Inc. (a)			1,217,986	4,707,417	0.5
Repsol SA			454,963	5,220,773	0.6
Royal Dutch Shell PLC - Class A			560,945	11,158,844	1.2
Royal Dutch Shell PLC - Class A (London)			36,134	716,153	0.1
				<u>21,803,187</u>	<u>2.4</u>
				<u>902,160,650</u>	<u>96.9</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIEN					
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
Power Grid Corp. of India Ltd.			1,371,254	3,288,557	0.3
Gesamtanlagen				<u>\$ 905,449,207</u>	<u>97.2%</u>
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	(0.13)%	–		93,019	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.00 %	–		2,857	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.59)%	–		87,331	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.08)%	–		100,490	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.01 %	–		86,015	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.38)%	–		87,688	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	–		91,603	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(b)	(0.78)%	–		92,902	0.0
JPMorgan Chase, New York(b)	0.01 %	–		20,082,456	2.2
SEB, Stockholm(b)	(0.26)%	–		93,319	0.0
SEB, Stockholm(b)	0.01 %	–		3,044,445	0.4
Sumitomo, London(b)	(0.28)%	–		91,844	0.0
Sumitomo, Tokyo(b)	0.00 %	–		92,912	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>24,046,881</u>	<u>2.6</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>1,839,933</u>	<u>0.2</u>
Nettovermögen				<u>\$ 931,336,021</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	USD	2,518	ILS	8,210	09/14/2021	\$ 41,773
Bank of America, NA	AUD	6,955	USD	5,376	09/16/2021	287,741
Bank of America, NA	USD	3,557	EUR	2,997	09/16/2021	(16,964)
Brown Brothers Harriman & Co.	ILS	12,277	USD	3,785	09/14/2021	(42,163)
Brown Brothers Harriman & Co.	USD	386	ILS	1,273	09/14/2021	10,660
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR	5,966	USD	7,224	09/16/2021	177,204
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	32,905	AUD	45,423	10/01/2021	330,862
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6,652	CAD	8,447	10/01/2021	43,620
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	1,250	EUR	1,063	10/01/2021	5,875
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	28,417	GBP	20,724	10/01/2021	78,131
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD	6,732	SGD	9,102	10/01/2021	37,212

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD	6,413	ZAR	96,043	10/01/2021	\$ 172,564
Citibank, NA	USD	2,267	EUR	1,918	09/16/2021	(2,442)
Credit Suisse International.....	EUR	675	USD	799	09/16/2021	742
Deutsche Bank AG.....	ILS	12,074	USD	3,722	09/14/2021	(42,078)
Goldman Sachs Bank USA	PLN	17,651	USD	4,672	09/16/2021	63,521
Goldman Sachs Bank USA	CNH	19,435	USD	2,970	12/16/2021	(15,984)
JPMorgan Chase Bank, NA.....	EUR	20,372	USD	24,745	09/16/2021	683,623
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	648	ILS	2,133	09/14/2021	16,781
Morgan Stanley Capital Services LLC	CNH	147,904	USD	22,765	09/16/2021	(122,680)
Morgan Stanley Capital Services LLC	EUR	9,547	USD	11,416	09/16/2021	140,511
Morgan Stanley Capital Services LLC	USD	2,329	EUR	1,968	09/16/2021	(4,110)
Morgan Stanley Capital Services LLC	KRW	10,812,764	USD	9,482	10/28/2021	156,864
Royal Bank of Scotland PLC.....	EUR	2,646	USD	3,129	09/16/2021	4,042
State Street Bank & Trust Co.	EUR	2,137	USD	2,597	09/16/2021	72,716
						\$ 2,078,021
					Wertsteigerung	\$ 2,324,442
					Wertminderung	\$ (246,421)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CAD – Canadian Dollar
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- CNY – Chinese Yuan Renminbi
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- ILS – Israeli Shekel
- KRW – South Korean Won
- PLN – Polish Zloty
- SGD – Singapore Dollar
- USD – United States Dollar
- ZAR – South African Rand

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			
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bandhan Bank Ltd.	467,883	\$ 1,817,926	0.3%
Bank for Foreign Trade of Vietnam JSC	1,802,230	7,859,148	1.1
Capitec Bank Holdings Ltd.	22,066	2,882,688	0.4
HDFC Bank Ltd.	936,555	20,192,822	2.7
KakaoBank Corp.	10,600	767,036	0.1
Sberbank of Russia PJSC (Sponsored ADR)	1,636,086	29,154,321	3.9
TCS Group Holding PLC (GDR)	188,160	16,641,555	2.2
		<u>79,315,496</u>	<u>10.7</u>
FINANZWESEN – VERBRAUCHER			
Manappuram Finance Ltd.	4,655,033	10,190,209	1.4
Muangthai Capital PCL	2,024,200	4,066,298	0.5
Muthoot Finance Ltd.	383,626	7,961,358	1.1
		<u>22,217,865</u>	<u>3.0</u>
VERSICHERUNGEN			
AIA Group Ltd.	1,721,200	20,552,379	2.8
Max Financial Services Ltd.	255,900	3,813,860	0.5
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	210,500	1,629,919	0.2
		<u>25,996,158</u>	<u>3.5</u>
SPARKONTEN UND HYPOTHEKENFINANZIERUNG			
Housing Development Finance Corp., Ltd.	723,677	27,603,994	3.7
		<u>155,133,513</u>	<u>20.9</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Samsung SDI Co., Ltd.	27,640	18,839,073	2.5
Sinbon Electronics Co., Ltd.	1,609,000	12,518,535	1.7
		<u>31,357,608</u>	<u>4.2</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
FPT Corp.	166,568	675,182	0.1
GDS Holdings Ltd.	266,900	1,930,873	0.3
GDS Holdings Ltd. (ADR)	216,210	12,643,961	1.7
Network International Holdings PLC	578,500	3,111,412	0.4
		<u>18,361,428</u>	<u>2.5</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Broadcom, Inc.	15,490	7,701,783	1.0
MediaTek, Inc.	603,000	19,553,621	2.6
SK Hynix, Inc.	86,580	7,927,301	1.1
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	2,652,000	58,172,254	7.9
		<u>93,354,959</u>	<u>12.6</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	113,530	7,495,049	1.0
		<u>150,569,044</u>	<u>20.3</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
NIO, Inc. (ADR)	87,430	3,436,873	0.5
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Fu Shou Yuan International Group Ltd.	7,501,000	6,766,065	0.9
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Despegar.com Corp.	734,670	8,808,693	1.2
MakeMyTrip Ltd.	334,560	8,638,339	1.2
OPAP SA	1,452,749	22,788,080	3.1
Premium Leisure Corp.	136,320,600	1,178,249	0.1
		<u>41,413,361</u>	<u>5.6</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	1,092,100	22,868,129	3.1
JD.com, Inc. - Class A	750,880	29,510,768	4.0
Naspers Ltd. - Class N (a)	18,960	3,271,341	0.4
		<u>55,650,238</u>	<u>7.5</u>
MULTILINE-EINZELHANDEL			
Lojas Renner SA	209,200	1,539,830	0.2

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Fila Holdings Corp.	39,460	\$ 1,524,929	0.2%
Samsonite International SA	4,942,200	<u>10,356,302</u>	<u>1.4</u>
		<u>11,881,231</u>	<u>1.6</u>
		<u>120,687,598</u>	<u>16.3</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
HUYA, Inc. (ADR) (a)	390,710	4,176,690	0.6
NCSOFT Corp.	9,920	<u>5,641,577</u>	<u>0.8</u>
		<u>9,818,267</u>	<u>1.4</u>
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
NAVER Corp.	74,750	28,303,127	3.8
Tencent Holdings Ltd.	889,600	<u>54,944,186</u>	<u>7.4</u>
		<u>83,247,313</u>	<u>11.2</u>
		<u>93,065,580</u>	<u>12.6</u>
INDUSTRIEGÜTER			
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
A-Living Smart City Services Co., Ltd. - Class H	4,081,500	16,221,295	2.2
Sunny Friend Environmental Technology Co., Ltd.	1,459,000	<u>10,813,645</u>	<u>1.4</u>
		<u>27,034,940</u>	<u>3.6</u>
BAU- UND INGENIEURWESEN			
Sinopec Engineering Group Co., Ltd. - Class H	18,851,000	<u>9,988,486</u>	<u>1.3</u>
MASCHINEN			
Techtronic Industries Co., Ltd.	118,000	<u>2,611,602</u>	<u>0.4</u>
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
HeadHunter Group PLC (ADR)	318,097	<u>16,862,322</u>	<u>2.3</u>
STRASSE UND SCHIENE			
Globaltrans Investment PLC (Sponsored GDR)	1,890,263	<u>15,500,157</u>	<u>2.1</u>
		<u>71,997,507</u>	<u>9.7</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSTRÜSTUNG UND BEDARF			
Lepu Medical Technology Beijing Co., Ltd. - Class A	905,400	3,622,406	0.5
Yestar Healthcare Holdings Co., Ltd.	7,767,500	<u>1,108,580</u>	<u>0.1</u>
		<u>4,730,986</u>	<u>0.6</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Universal Vision Biotechnology Co., Ltd.	1,143,000	<u>12,912,434</u>	<u>1.7</u>
GESUNDHEITSWESEN – TECHNOLOGIE			
Alibaba Health Information Technology Ltd.	4,352,000	<u>7,183,327</u>	<u>1.0</u>
PHARMAZEUTIKA			
Genomma Lab Internacional SAB de CV - Class B	14,465,696	<u>13,951,430</u>	<u>1.9</u>
		<u>38,778,177</u>	<u>5.2</u>
GRUNDSTOFFE			
METALL UND BERGBAU			
Anglo American PLC	226,070	9,548,181	1.3
Antofagasta PLC	137,670	2,757,787	0.4
Freeport-McMoRan, Inc.	270,700	9,850,773	1.3
MMC Norilsk Nickel PJSC (ADR)	227,380	<u>7,469,433</u>	<u>1.0</u>
		<u>29,626,174</u>	<u>4.0</u>
VERSORGUNG			
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE			
Equatorial Energia SA	4,059,800	<u>19,981,803</u>	<u>2.7</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Dino Polska SA	44,710	<u>3,789,112</u>	<u>0.5</u>
HAUSHALTSPRODUKTE			
C&S Paper Co., Ltd.	4,768,101	<u>13,539,552</u>	<u>1.8</u>
		<u>17,328,664</u>	<u>2.3</u>
IMMOBILIEN			
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG			
China Overseas Property Holdings Ltd.	3,355,000	<u>2,861,232</u>	<u>0.4</u>
		<u>700,029,292</u>	<u>94.4</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
AKTIENANLEIHEN					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
FPT Corp. Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			3,431,394	\$ 13,916,859	1.9%
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL					
Mobile World Investment Corp. Macquarie Bank Ltd., expiring 03/31/2023			865,939	4,218,994	0.5
				18,135,853	2.4
				718,165,145	96.8
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN					
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE					
Safaricom PLC			11,019,880	4,245,634	0.6
Gesamtanlagen				\$ 722,410,779	97.4%
(Kosten \$635,559,202)					
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	(0.13)%	–		4,609	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(b)	0.01 %	–		113	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.00 %	–		4,196	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.78)%	–		4,120	0.0
Citibank, New York(b)	0.01 %	–		3,032,619	0.4
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.38)%	–		1,160	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	–		73,186	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(b)	0.01 %	–		51,024	0.0
SEB, Stockholm(b)	(0.26)%	–		105	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	–		123	0.0
Termineinlagen insgesamt				3,171,255	0.4
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				16,376,091	2.2
Nettovermögen				\$ 741,958,125	100.0%

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei		Verträge zur Lieferung (000)		Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD	3,914	AUD	5,403	10/01/2021	\$ 39,703
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD	493	PLN	1,923	10/01/2021	9,055
Brown Brothers Harriman & Co.+.	USD	33	SGD	45	10/01/2021	183
						\$ 48,941

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
KOMMUNIKATIONS-AUSRÜSTUNG			
Ciena Corp.	298,315	\$ 17,042,736	1.7%
Lumentum Holdings, Inc.	240,737	20,857,454	2.1
Motorola Solutions, Inc.	106,350	25,972,797	2.7
		<u>63,872,987</u>	<u>6.5</u>
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Flex Ltd.	1,277,177	23,729,949	2.4
Keysight Technologies, Inc.	86,979	15,602,293	1.6
TE Connectivity Ltd.	134,120	20,147,506	2.1
		<u>59,479,748</u>	<u>6.1</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
MAXIMUS, Inc.	159,778	13,915,066	1.4
PayPal Holdings, Inc.	73,764	21,292,716	2.2
Square, Inc. - Class A	61,806	16,568,334	1.7
Twilio, Inc. - Class A	24,780	8,845,469	0.9
Visa, Inc. - Class A	82,100	18,809,110	1.9
		<u>79,430,695</u>	<u>8.1</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
Cree, Inc.	114,370	9,719,163	1.0
Monolithic Power Systems, Inc.	34,215	16,934,030	1.8
NVIDIA Corp.	62,146	13,911,382	1.4
NXP Semiconductors NV	99,640	21,435,553	2.2
		<u>62,000,128</u>	<u>6.4</u>
SOFTWARE			
Adobe, Inc.	35,363	23,470,423	2.4
ANSYS, Inc.	37,150	13,573,124	1.4
Coinbase Global, Inc.	34,700	8,987,300	0.9
Microsoft Corp.	82,448	24,889,403	2.6
Zendesk, Inc.	87,247	10,783,729	1.1
		<u>81,703,979</u>	<u>8.4</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Apple, Inc.	150,658	22,874,404	2.3
		<u>369,361,941</u>	<u>37.8</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Alcon, Inc.	253,348	20,893,609	2.1
Danaher Corp.	90,556	29,354,633	3.0
Koninklijke Philips NV (ADR)	373,716	17,239,519	1.8
STERIS PLC	95,200	20,468,952	2.1
		<u>87,956,713</u>	<u>9.0</u>
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Laboratory Corp. of America Holdings	93,400	28,335,692	2.9
UnitedHealth Group, Inc.	30,229	12,583,426	1.3
		<u>40,919,118</u>	<u>4.2</u>
LIFE SCIENCES – HILFSMITTEL UND DIENSTLEISTUNGEN			
Bio-Rad Laboratories, Inc. - Class A	37,673	30,319,984	3.1
Bruker Corp.	248,777	21,969,497	2.2
		<u>52,289,481</u>	<u>5.3</u>
		<u>181,165,312</u>	<u>18.5</u>
INDUSTRIEGÜTER			
LUFTFAHRT UND VERTEIDIGUNG			
Hexcel Corp.	277,340	15,727,951	1.6
BAUPRODUKTE			
Trex Co., Inc.	216,534	23,766,772	2.5
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Tetra Tech, Inc.	86,141	12,390,521	1.3
Waste Management, Inc.	161,252	25,011,798	2.5
		<u>37,402,319</u>	<u>3.8</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Rockwell Automation, Inc.	72,450	23,578,852	2.4
Vestas Wind Systems A/S (Sponsored ADR) (a)	1,285,459	17,315,133	1.8
		<u>40,893,985</u>	<u>4.2</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MASCHINEN					
Xylem, Inc./NY			144,945	\$ 19,757,453	2.0%
				<u>137,548,480</u>	<u>14.1</u>
FINANZWERTE					
BANKEN					
SVB Financial Group			44,180	24,718,710	2.5
KAPITALMÄRKTE					
Intercontinental Exchange, Inc.			166,112	19,855,367	2.0
MSCI, Inc. - Class A			43,622	27,681,649	2.9
				<u>47,537,016</u>	<u>4.9</u>
VERSICHERUNGEN					
Aflac, Inc.			340,657	19,308,439	2.0
				<u>91,564,165</u>	<u>9.4</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
KFZ-BESTANDTEILE					
Aptiv PLC			122,547	18,650,428	1.9
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER					
TopBuild Corp.			80,245	17,556,804	1.8
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL					
Home Depot, Inc. (The)			64,115	20,913,031	2.2
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER					
NIKE, Inc. - Class B			143,902	23,706,415	2.4
				<u>80,826,678</u>	<u>8.3</u>
VERSORGUNG					
STROMVERSORGUNGSBETRIEBE					
NextEra Energy, Inc.			269,566	22,640,848	2.3
WASSERVERSORGER					
American Water Works Co., Inc.			98,407	17,934,676	1.8
				<u>40,575,524</u>	<u>4.1</u>
IMMOBILIEN					
AKTIEN-IMMOBILIENINVESTMENTGESELLSCHAFTEN (REITS)					
SBA Communications Corp.			48,903	17,554,710	1.8
VERBRAUCHSGÜTER					
HAUSHALTSPRODUKTE					
Procter & Gamble Co. (The)			90,629	12,904,663	1.3
Gesamtanlagen					
(Kosten \$722,069,386)				\$ 931,501,473	95.3%
Termineinlagen					
DnB Bank ASA, Oslo(b)	(0.78)%	–		63	0.0
SEB, Stockholm(b)	0.01 %	–		53,985,906	5.5
				<u>53,985,969</u>	<u>5.5</u>
Termineinlagen insgesamt					
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten					
				<u>(7,833,916)</u>	<u>(0.8)</u>
Nettovermögen					
				<u>\$ 977,653,526</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,527	AUD 3,489	10/01/2021	\$ 25,807
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 7,053	CAD 8,955	10/01/2021	45,045
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 19,733	EUR 16,797	10/01/2021	111,720
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,348	GBP 1,712	10/01/2021	6,224
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 35	JPY 3,858	10/01/2021	75
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 3,091	SGD 4,179	10/01/2021	17,072
				<u>\$ 205,943</u>

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

ADR – American Depositary Receipt
REIT – Real Estate Investment Trust

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
FINANZWERTE			
BANKEN			
Bank Negara Indonesia Persero Tbk PT	18,231,500	\$ 6,902,724	1.8%
Bank of the Philippine Islands	1,649,580	2,758,695	0.7
China Construction Bank Corp. - Class H	6,151,000	4,444,724	1.2
CTBC Financial Holding Co., Ltd.	2,220,000	1,842,423	0.5
Dah Sing Financial Holdings Ltd.	421,000	1,309,967	0.3
Hana Financial Group, Inc.	323,000	12,550,045	3.4
ICICI Bank Ltd.	300,723	2,959,552	0.8
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	1,935,400	5,547,664	1.5
Kasikornbank PCL (Foreign Shares)	913,700	3,472,528	0.9
KB Financial Group, Inc.	304,930	13,912,456	3.7
Metropolitan Bank & Trust Co.	2,929,200	2,661,303	0.7
Shinhan Financial Group Co., Ltd.	96,730	3,241,158	0.9
State Bank of India	1,444,175	8,416,895	2.3
		<u>70,020,134</u>	<u>18.7</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
Fubon Financial Holding Co., Ltd.	1,134,000	3,478,088	0.9
Metro Pacific Investments Corp.	21,986,000	1,701,429	0.5
		<u>5,179,517</u>	<u>1.4</u>
		<u>75,199,651</u>	<u>20.1</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
E Ink Holdings, Inc.	711,000	2,008,815	0.6
Simplo Technology Co., Ltd.	335,000	3,819,799	1.0
		<u>5,828,614</u>	<u>1.6</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
21Vianet Group, Inc. (ADR)	155,990	3,087,042	0.8
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
King Yuan Electronics Co., Ltd.	2,633,000	4,332,358	1.2
Nanya Technology Corp.	1,296,000	3,105,144	0.8
Novatek Microelectronics Corp.	315,000	5,103,469	1.4
Realtek Semiconductor Corp.	269,000	5,377,379	1.4
SK Hynix, Inc.	37,310	3,427,069	0.9
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	868,000	19,230,772	5.1
United Microelectronics Corp.	6,545,000	14,902,106	4.0
		<u>55,478,297</u>	<u>14.8</u>
TECHNOLOGIE – HARDWARE, SPEICHERUNG UND PERIPHERIEGERÄTE			
Samsung Electronics Co., Ltd.	138,370	9,153,460	2.5
		<u>73,547,413</u>	<u>19.7</u>
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
Astra International Tbk PT	6,357,000	2,328,857	0.6
Dongfeng Motor Group Co., Ltd. - Class H	1,732,000	1,897,362	0.5
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class H	1,915,500	8,817,144	2.4
Hyundai Motor Co.	25,570	4,686,382	1.2
Kia Corp.	122,090	8,961,024	2.4
Maruti Suzuki India Ltd.	66,939	6,268,056	1.7
		<u>32,958,825</u>	<u>8.8</u>
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Galaxy Entertainment Group Ltd.	780,000	4,999,454	1.3
Jollibee Foods Corp.	337,000	1,366,967	0.4
Melco Resorts & Entertainment Ltd. (ADR)	265,400	3,651,904	1.0
Tongcheng-Elong Holdings Ltd.	1,951,200	4,540,912	1.2
		<u>14,559,237</u>	<u>3.9</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	339,500	7,224,379	2.0
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	640,500	5,352,976	1.4
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Samsonite International SA	1,970,700	4,125,130	1.1
		<u>64,220,547</u>	<u>17.2</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Hansol Chemical Co., Ltd.	19,770	\$ 4,953,370	1.3%
LB Group Co., Ltd. - Class A	467,000	2,713,413	0.7
LG Chem Ltd.	2,130	1,392,505	0.4
		<u>9,059,288</u>	<u>2.4</u>
METALL UND BERGBAU			
Baoshan Iron & Steel Co., Ltd. - Class A	1,873,600	2,958,140	0.8
China Hongqiao Group Ltd.	2,320,000	3,460,260	0.9
Hindalco Industries Ltd.	1,257,361	8,084,173	2.2
Jiangxi Copper Co., Ltd. - Class H	1,059,000	2,154,097	0.6
POSCO	21,980	6,388,598	1.7
		<u>23,045,268</u>	<u>6.2</u>
		<u>32,104,556</u>	<u>8.6</u>
VERSORGUNG			
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	620,000	3,762,673	1.0
GAIL India Ltd.	3,719,895	7,454,311	2.0
Kunlun Energy Co., Ltd.	10,864,000	11,510,117	3.1
		<u>22,727,101</u>	<u>6.1</u>
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
China Longyuan Power Group Corp., Ltd. - Class H	3,464,000	7,063,889	1.9
		<u>29,790,990</u>	<u>8.0</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Telkom Indonesia Persero Tbk PT	24,434,500	5,824,876	1.6
UNTERHALTUNG			
International Games System Co., Ltd.	121,000	2,899,093	0.8
DRAHTLOSE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Bharti Airtel Ltd.	717,653	6,504,414	1.7
		<u>15,228,383</u>	<u>4.1</u>
IMMOBILIEN			
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Ayala Land, Inc.	5,161,900	3,501,792	0.9
CIFI Holdings Group Co., Ltd.	5,788,000	3,899,623	1.0
Megaworld Corp.	31,599,000	1,791,139	0.5
Midea Real Estate Holding Ltd.	1,482,600	2,943,297	0.8
Times China Holdings Ltd.	2,749,000	2,841,800	0.8
		<u>14,977,651</u>	<u>4.0</u>
INDUSTRIEGÜTER			
BAUPRODUKTE			
Xinyi Glass Holdings Ltd.	454,000	1,908,826	0.5
Zhuzhou Kibing Group Co., Ltd. - Class A	1,028,300	4,346,422	1.2
		<u>6,255,248</u>	<u>1.7</u>
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
NARI Technology Co., Ltd. - Class A	1,063,820	5,770,693	1.5
TRANSPORTWESEN – INFRASTRUKTUR			
Jiangsu Expressway Co., Ltd. - Class H	2,060,000	2,137,487	0.6
		<u>14,163,428</u>	<u>3.8</u>
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
PetroChina Co., Ltd. - Class H	19,916,000	8,732,111	2.3
VERBRAUCHSGÜTER			
LEBENSMITTELPRODUKTE			
WH Group Ltd.	7,769,500	6,743,100	1.8
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class H	2,243,300	4,453,458	1.2
PHARMAZEUTIKA			
China Resources Pharmaceutical Group Ltd.	2,293,700	1,194,413	0.3
		<u>5,647,871</u>	<u>1.5</u>
		<u>340,355,701</u>	<u>91.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
AKTIENANLEIHEN					
INFORMATIONSTECHNOLOGIE					
IT-DIENSTLEISTUNGEN					
FPT Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 04/05/2023			1,967,424	\$ 7,979,370	2.1%
FINANZWERTE					
BANKEN					
Asia Commercial Bank JSC, expiring 03/09/2023			1,233,237	1,732,189	0.5
Military Commercial Joint, Macquarie Bank Ltd., expiring 04/05/2023			1,588,527	1,945,348	0.5
Vietnam Technological & Commercial Joint Stock Bank, Macquarie Bank Ltd., expiring 08/10/2022			369,080	785,708	0.2
				<u>4,463,245</u>	<u>1.2</u>
IMMOBILIEN					
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG					
Vincome Retail, Macquarie Bank Ltd., expiring 04/05/2023			2,831,560	3,393,024	0.9
NICHT-BASISKONSUMGÜTER					
SPEZIALISIRTER EINZELHANDEL					
Mobile World Investment Corp., Macquarie Bank Ltd., expiring 04/05/2023			229,950	1,120,353	0.3
				<u>16,955,992</u>	<u>4.5</u>
				<u>357,311,693</u>	<u>95.6</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
VERSORGUNG					
STROMVERSORGBETRIEBE					
Power Grid Corp. of India Ltd.			2,301,537	5,527,850	1.5
Gesamtanlagen					
(Kosten \$314,155,060)				\$ 362,839,543	97.1%
Termineinlagen					
ANZ, London(a)	(0.13)%	–		1,119	0.0
BBH, Grand Cayman(a)	4.00 %	–		7,480	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	0.01 %	–		35,584	0.0
BNP Paribas, Paris(a)	0.01 %	–		793	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(a)	0.00 %	–		66,104	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(a)	0.01 %	–		24,460	0.0
Sumitomo, London(a)	(0.28)%	–		25,180	0.0
Sumitomo, London(a)	0.01 %	–		11,340,036	3.0
Termineinlagen insgesamt				<u>11,500,756</u>	<u>3.0</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(491,186)</u>	<u>(0.1)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 373,849,113</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 16	CNH 107	09/08/2021	\$ 199
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 34,200	AUD 47,213	10/01/2021	344,735
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,334	CAD 8,044	10/01/2021	41,545
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 570	EUR 485	10/01/2021	3,221
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,999	GBP 4,375	10/01/2021	16,499
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,904	NZD 8,507	10/01/2021	90,290
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 118	SGD 160	10/01/2021	654
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 18,098	ZAR 271,112	10/01/2021	490,427
				<u>\$ 987,570</u>

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

(a) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

- ADR – American Depositary Receipt
- JSC – Joint Stock Company

	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KFZ-BESTANDTEILE			
NGK Spark Plug Co., Ltd.	77,000	¥ 130,284,000	1.5%
Sumitomo Electric Industries Ltd.	122,500	180,136,250	2.1
Toyo Tire Corp.	117,700	230,221,200	2.7
Toyota Industries Corp.	13,700	127,273,000	1.5
TS Tech Co., Ltd.	43,100	64,262,100	0.8
		<u>732,176,550</u>	<u>8.6</u>
KRAFTFAHRZEUGE			
Honda Motor Co., Ltd.	81,100	271,036,200	3.2
Suzuki Motor Corp.	48,500	230,666,000	2.7
		<u>501,702,200</u>	<u>5.9</u>
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Benesse Holdings, Inc.	55,600	132,216,800	1.6
HAUSHALTSGEBRAUCHSGÜTER			
Panasonic Corp.	89,200	117,030,400	1.4
Sony Group Corp.	22,500	255,600,000	3.0
		<u>372,630,400</u>	<u>4.4</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
ASKUL Corp.	66,600	114,818,400	1.3
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Asics Corp.	13,100	30,588,500	0.4
		<u>1,884,132,850</u>	<u>22.2</u>
INDUSTRIEGÜTER			
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
Park24 Co., Ltd.	62,100	131,838,300	1.5
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Fuji Electric Co., Ltd.	33,700	160,580,500	1.9
INDUSTRIEKONZERNE			
Hitachi Ltd.	33,100	201,413,500	2.4
MASCHINEN			
IHI Corp.	42,600	104,199,600	1.2
PROFESSIONELLE DIENSTLEISTUNGEN			
Outsourcing, Inc.	86,300	162,244,000	1.9
UT Group Co., Ltd.	44,400	134,088,000	1.6
		<u>296,332,000</u>	<u>3.5</u>
STRASSE UND SCHIENE			
East Japan Railway Co.	22,900	170,169,900	2.0
Sankyu, Inc.	34,000	174,420,000	2.1
		<u>344,589,900</u>	<u>4.1</u>
HANDELSGESELLSCHAFTEN UND VERTRAGSHÄNDLER			
Mitsubishi Corp.	79,600	263,555,600	3.1
		<u>1,502,509,400</u>	<u>17.7</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Asahi Group Holdings Ltd.	22,036	112,692,104	1.3
Coca-Cola Bottlers Japan Holdings, Inc. (a)	43,200	66,268,800	0.8
Kirin Holdings Co., Ltd.	38,100	75,971,400	0.9
		<u>254,932,304</u>	<u>3.0</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Seven & i Holdings Co., Ltd. (a)	45,300	218,119,500	2.6
Sundrug Co., Ltd.	32,900	120,249,500	1.4
		<u>338,369,000</u>	<u>4.0</u>
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Morinaga & Co., Ltd./Japan	14,400	55,584,000	0.7
Nichirei Corp.	65,000	182,260,000	2.1
		<u>237,844,000</u>	<u>2.8</u>
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
Pola Orbis Holdings, Inc.	55,400	133,181,600	1.6
TABAK			
Japan Tobacco, Inc.	64,600	137,759,500	1.6
		<u>1,102,086,404</u>	<u>13.0</u>

	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
Oki Electric Industry Co., Ltd.	151,200	¥ 149,385,600	1.7%
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
Fujitsu Ltd.	9,300	188,790,000	2.2
NEC Networks & System Integration Corp.	43,700	91,726,300	1.1
Otsuka Corp.	23,200	132,240,000	1.6
		<u>412,756,300</u>	<u>4.9</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
SCREEN Holdings Co., Ltd.	24,600	232,224,000	2.7
SOFTWARE			
Oracle Corp. Japan	8,100	73,224,000	0.9
		<u>867,589,900</u>	<u>10.2</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
DIVERSIFIZIERTE TELEKOMMUNIKATIONSDIENSTE			
Nippon Telegraph & Telephone Corp.	143,700	421,903,200	5.0
UNTERHALTUNG			
Konami Holdings Corp.	29,700	207,306,000	2.4
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Z Holdings Corp.	60,900	43,665,300	0.5
		<u>672,874,500</u>	<u>7.9</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Mitsubishi UFJ Financial Group, Inc.	472,300	280,735,120	3.3
Sumitomo Mitsui Financial Group, Inc.	54,300	206,394,300	2.4
		<u>487,129,420</u>	<u>5.7</u>
DIVERSIFIZIERTE FINANZDIENSTLEISTUNGEN			
ORIX Corp.	85,200	174,787,800	2.1
		<u>661,917,220</u>	<u>7.8</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Air Water, Inc.	76,100	135,001,400	1.6
Tosoh Corp.	90,900	181,618,200	2.1
Zeon Corp.	87,800	128,188,000	1.5
		<u>444,807,600</u>	<u>5.2</u>
CONTAINER UND VERPACKUNGEN			
Rengo Co., Ltd.	81,000	72,657,000	0.9
METALL UND BERGBAU			
Sumitomo Metal Mining Co., Ltd.	20,500	86,592,000	1.0
		<u>604,056,600</u>	<u>7.1</u>
GESUNDHEITSWESEN			
PHARMAZEUTIKA			
Nippon Shinyaku Co., Ltd.	32,200	287,546,000	3.4
Santen Pharmaceutical Co., Ltd.	93,100	152,684,000	1.8
		<u>440,230,000</u>	<u>5.2</u>
IMMOBILIEN			
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLIESSUNG			
Daito Trust Construction Co., Ltd.	6,500	78,520,000	0.9
Mitsui Fudosan Co., Ltd.	93,600	236,246,400	2.8
		<u>314,766,400</u>	<u>3.7</u>
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
ENEOS Holdings, Inc.	550,700	234,653,270	2.8
VERSORGUNG			
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
Tokyo Gas Co., Ltd.	39,400	83,370,400	1.0
Gesamtanlagen			
(Kosten ¥7,940,621,511)		¥ 8,368,186,944	98.6%

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (JPY)	Nettover- mögen %
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	(0.13)%	–		¥ 33,921	0.0%
BBH, Grand Cayman(b)	0.01 %	–		2	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.00 %	–		175,535	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.01 %	–		20,683	0.0
Sumitomo, London(b)	(0.28)%	–		120,425,264	1.4
Sumitomo, Tokyo(b)	0.01 %	–		<u>2,302,809</u>	<u>0.1</u>
Termineinlagen insgesamt				<u>122,958,214</u>	<u>1.5</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(8,144,793)</u>	<u>(0.1)</u>
Nettovermögen				<u>¥ 8,483,000,365</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 444,467	AUD 5,565	10/01/2021	¥ 3,395,114
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 2,017	CZK 398	10/01/2021	17,001
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 82,438	EUR 637	10/01/2021	291,044
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 54,128	NZD 707	10/01/2021	696,372
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 777	SGD 10	10/01/2021	2,641
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 811,922	USD 7,366	10/01/2021	(1,740,183)
Brown Brothers Harriman & Co.+	JPY 39,407	ZAR 5,355	10/01/2021	973,916
				<u>¥ 3,635,905</u>
			Wertsteigerung	¥ 5,376,088
			Wertminderung	¥ (1,740,183)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE			
STAMMAKTIE			
NICHT-BASISKONSUMGÜTER			
KRAFTFAHRZEUGE			
Great Wall Motor Co., Ltd. - Class H	349,000	\$ 1,606,465	1.1%
DIVERSIFIZIERTE VERBRAUCHERDIENSTE			
Fu Shou Yuan International Group Ltd.	3,735,000	3,366,444	2.2
HOTELS, RESTAURANTS UND FREIZEIT			
Galaxy Entertainment Group Ltd.	321,000	2,057,467	1.3
Jiumaojiu International Holdings Ltd. (a)	981,000	3,292,095	2.2
Melco Resorts & Entertainment Ltd. (ADR)	35,270	485,315	0.3
Tongcheng-Elong Holdings Ltd.	886,400	2,062,866	1.3
		<u>7,897,743</u>	<u>5.1</u>
EINZELHANDEL – INTERNET UND DIREKTVERTRIEB			
Alibaba Group Holding Ltd.	437,760	9,315,300	6.1
SPEZIALISIERTER EINZELHANDEL			
Topsports International Holdings Ltd.	1,074,000	1,419,581	0.9
Zhongsheng Group Holdings Ltd.	351,000	2,933,481	1.9
		<u>4,353,062</u>	<u>2.8</u>
TEXTILIEN, BEKLEIDUNG UND LUXUSGÜTER			
Bosideng International Holdings Ltd.	3,082,000	2,520,302	1.6
Li Ning Co., Ltd.	253,000	3,399,379	2.2
LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton SE	1,960	1,450,584	0.9
Samsonite International SA	353,100	739,120	0.5
Shenzhou International Group Holdings Ltd.	89,000	1,940,790	1.3
Stella International Holdings Ltd.	1,544,000	2,076,547	1.4
		<u>12,126,722</u>	<u>7.9</u>
		<u>38,665,736</u>	<u>25.2</u>
FINANZWERTE			
BANKEN			
Agricultural Bank of China Ltd. - Class H	10,543,000	3,538,079	2.3
Bank of Hangzhou Co., Ltd. - Class A	963,200	1,998,319	1.3
China Construction Bank Corp. - Class H	11,070,100	7,999,275	5.2
China Merchants Bank Co., Ltd. - Class H	321,500	2,655,931	1.7
Industrial Bank Co., Ltd. - Class A	827,900	2,373,107	1.6
Ping An Bank Co., Ltd. - Class A	869,236	2,397,316	1.6
		<u>20,962,027</u>	<u>13.7</u>
KAPITALMÄRKTE			
CITIC Securities Co., Ltd. - Class H	268,500	680,101	0.4
VERSICHERUNGEN			
Ping An Insurance Group Co. of China Ltd. - Class H	549,500	4,267,440	2.8
		<u>25,909,568</u>	<u>16.9</u>
INFORMATIONSTECHNOLOGIE			
ELEKTRONISCHE AUSTRÜSTUNG, INSTRUMENTE UND KOMPONENTEN			
GoerTek, Inc. - Class A	182,600	1,316,724	0.8
Kingboard Holdings Ltd.	274,000	1,347,550	0.9
Shanghai Friendess Electronic Technology Corp. Ltd.	19,200	1,488,925	1.0
Simplo Technology Co., Ltd.	173,000	1,972,613	1.3
Wuxi Lead Intelligent Equipment Co., Ltd. - Class A	122,500	1,415,933	0.9
		<u>7,541,745</u>	<u>4.9</u>
IT-DIENSTLEISTUNGEN			
21Vianet Group, Inc. (ADR)	51,290	1,015,029	0.7
GDS Holdings Ltd.	393,560	2,762,908	1.8
		<u>3,777,937</u>	<u>2.5</u>
HALBLEITER UND HALBLEITERAUSRÜSTUNG			
LONGi Green Energy Technology Co., Ltd. - Class A	55,900	774,833	0.5
Novatek Microelectronics Corp.	64,000	1,036,895	0.7
Taiwan Semiconductor Manufacturing Co., Ltd.	59,000	1,307,161	0.8
		<u>3,118,889</u>	<u>2.0</u>
		<u>14,438,571</u>	<u>9.4</u>
VERSORGUNG			
GASVERSORGUNGSBETRIEBE			
China Resources Gas Group Ltd.	372,000	2,257,604	1.4
ENN Energy Holdings Ltd.	124,000	2,453,709	1.6
Kunlun Energy Co., Ltd.	5,324,000	5,640,636	3.7
		<u>10,351,949</u>	<u>6.7</u>

	Anteile	Wert (USD)	Nettover- mögen %
UNABHÄNGIGE STROM- UND ERNEUERBARE ELEKTRIZITÄTSPRODUZENTEN			
China Yangtze Power Co., Ltd. - Class A	580,700	\$ 1,740,107	1.2%
Huaneng Lancang River Hydropower, Inc. - Class A	1,749,400	1,569,406	1.0
		<u>3,309,513</u>	<u>2.2</u>
		<u>13,661,462</u>	<u>8.9</u>
INDUSTRIEGÜTER			
BAUPRODUKTE			
Xinyi Glass Holdings Ltd.	580,000	2,438,589	1.6
GEWERBLICHE DIENSTLEISTUNGEN UND BEDARF			
CIFI Ever Sunshine Services Group Ltd.	1,727,820	3,567,852	2.3
ELEKTRISCHE AUSRÜSTUNG			
Contemporary Amperex Technology Co., Ltd. - Class A	18,800	1,441,506	0.9
NARI Technology Co., Ltd. - Class A	389,146	2,110,923	1.4
Qingdao TGOOD Electric Co., Ltd.	248,400	1,249,688	0.8
		<u>4,802,117</u>	<u>3.1</u>
INDUSTRIEKONZERNE			
Guoco Group Ltd.	91,000	1,053,044	0.7
		<u>11,861,602</u>	<u>7.7</u>
KOMMUNIKATIONSDIENSTLEISTUNGEN			
UNTERHALTUNG			
G-bits Network Technology Xiamen Co., Ltd. - Class A	28,400	1,613,208	1.1
INTERAKTIVE MEDIEN UND DIENSTLEISTUNGEN			
Tencent Holdings Ltd.	157,500	9,744,710	6.3
		<u>11,357,918</u>	<u>7.4</u>
VERBRAUCHSGÜTER			
GETRÄNKE			
Anhui Yingjia Distillery Co., Ltd. Class A	197,700	1,364,346	0.9
Kweichow Moutai Co., Ltd. - Class A	8,100	1,955,331	1.3
Tsingtao Brewery Co., Ltd. - Class H	142,000	1,163,029	0.7
		<u>4,482,706</u>	<u>2.9</u>
LEBENSMITTEL UND MASSENERZEUGNISSE – EINZELHANDEL			
Taiwan FamilyMart Co., Ltd./Taiwan	206,000	1,940,065	1.3
LEBENSMITTELPRODUKTE			
Nestle SA (REG)	15,440	1,951,434	1.3
KÖRPERPFLEGEPRODUKTE			
L'Occitane International SA	564,750	1,920,634	1.2
		<u>10,294,839</u>	<u>6.7</u>
GRUNDSTOFFE			
CHEMIKALIEN			
Shanghai Putailai New Energy Technology Co., Ltd. - Class A	79,400	1,882,260	1.2
BAUMATERIAL			
Huaxin Cement Co., Ltd. - Class A	402,300	1,203,026	0.8
METALL UND BERGBAU			
Baoshan Iron & Steel Co., Ltd. - Class A	2,557,252	4,037,526	2.6
Shandong Nanshan Aluminum Co., Ltd. - Class A	3,230,875	2,888,442	1.9
		<u>6,925,968</u>	<u>4.5</u>
		<u>10,011,254</u>	<u>6.5</u>
GESUNDHEITSWESEN			
GESUNDHEITSWESEN – AUSRÜSTUNG UND BEDARF			
Shenzhen Mindray Bio-Medical Electronics Co., Ltd.	19,100	970,678	0.6
GESUNDHEITSWESEN – ANBIETER UND DIENSTLEISTUNGEN			
Shanghai Pharmaceuticals Holding Co., Ltd. - Class H	671,800	1,333,675	0.9
PHARMAZEUTIKA			
Jiangsu Hengrui Medicine Co., Ltd. - Class A	152,373	1,067,122	0.7
Yunnan Baiyao Group Co., Ltd. - Class A	193,300	2,656,282	1.7
		<u>3,723,404</u>	<u>2.4</u>
		<u>6,027,757</u>	<u>3.9</u>
IMMOBILIEN			
IMMOBILIEN-MANAGEMENT UND -ERSCHLISSUNG			
KWG Living Group Holdings Ltd.	323,600	270,449	0.2
Midea Real Estate Holding Ltd. (a)	682,000	1,353,924	0.9
Times Neighborhood Holdings Ltd.	529,000	331,924	0.2
		<u>1,956,297</u>	<u>1.3</u>
ENERGIE			
ÖL, GAS UND VERBRAUCHSBRENNSTOFFE			
PetroChina Co., Ltd. - Class H	3,800,000	1,666,099	1.1

	Zinssatz	Datum	Anteile	Wert (USD)	Nettovermögen %
Gesamtanlagen					
(Kosten \$131,194,680).....				\$ 145,851,103	95.0%
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	(0.13)%	–		1,579	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	0.01 %	–		2	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.01 %	–		589	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	4.00 %	–		39,956	0.0
Credit Suisse AG, Zurich(b)	(1.38)%	–		15,623	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(b)	0.00 %	–		85,406	0.1
Sumitomo, London(b)	(0.28)%	–		775	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	–		8,430,335	5.4
Sumitomo, Tokyo(b)	(0.78)%	–		15,491	0.0
Termineinlagen insgesamt				8,589,756	5.5
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				(843,787)	(0.5)
Nettovermögen				\$ 153,597,072	100.0%

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 8	CNH 55	09/08/2021	\$ 101
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9	CNH 56	09/13/2021	61
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 14,822	AUD 20,460	10/01/2021	148,602
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 925	CAD 1,175	10/01/2021	6,079
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 593	EUR 505	10/01/2021	3,349
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,664	GBP 1,213	10/01/2021	4,583
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,362	NZD 1,962	10/01/2021	20,834
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 333	PLN 1,300	10/01/2021	6,111
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 22	SGD 30	10/01/2021	124
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 17,196	ZAR 257,534	10/01/2021	461,970
				\$ 651,814

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

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

Währungskürzel:

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

Glossar:

- ADR – American Depositary Receipt
REG – Registered Shares

Siehe Anmerkungen zum 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 139	3.25%	04/21/2025	AUD 23,233	\$ 18,776,914	3.5%
KANADA					
Canadian Government Bond, Series A55	8.00%	06/01/2023	CAD 9,879	8,870,167	1.7
CHINA					
Agricultural Bank of China Ltd.	3.05%	10/27/2023	CNH 31,196	4,853,970	0.9
FRANKREICH					
French Republic Government Bond OAT	8.50%	04/25/2023	EUR 2,003	2,725,984	0.5
IRLAND					
Ireland Government Bond	3.40%	03/18/2024	8,093	10,545,299	2.0
ITALIEN					
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.50%	03/01/2024	11,500	15,226,129	2.9
Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.50%	03/01/2026	18,680	26,587,197	5.0
				41,813,326	7.9
JAPAN					
Japan Government Twenty Year Bond, Series 55	2.00%	03/21/2022	JPY 1,071,976	9,857,391	1.9
Japan Government Twenty Year Bond, Series 56	2.00%	06/20/2022	1,037,417	9,589,810	1.8
Japan Government Twenty Year Bond, Series 64	1.90%	09/20/2023	757,042	7,167,729	1.3
Japan Government Twenty Year Bond, Series 71	2.20%	06/20/2024	1,984,219	19,216,697	3.6
				45,831,627	8.6
MEXIKO					
Mexican Bonos, Series M	8.00%	09/05/2024	MXN 95,304	4,991,436	1.0
RUSSLAND					
Russian Federal Bond - OFZ, Series 6227	7.40%	07/17/2024	RUB 394,372	5,471,334	1.0
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds	7.13%	02/15/2023	USD 25,634	28,205,879	5.3
U.S. Treasury Bonds	7.25%	08/15/2022	8,722	9,308,262	1.8
U.S. Treasury Bonds	7.50%	11/15/2024	53,989	66,153,104	12.4
				103,667,245	19.5
				247,547,302	46.6
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
PPG Industries, Inc.	0.88%	03/13/2022	EUR 881	1,044,474	0.2
INVESTITIONSGÜTER					
Johnson Controls International PLC	1.00%	09/15/2023	1,746	2,109,648	0.4
Parker-Hannifin Corp.	3.50%	09/15/2022	USD 1,292	1,332,358	0.3
Siemens Financieringsmaatschappij NV	0.00%	02/20/2023	EUR 1,462	1,737,102	0.3
Siemens Financieringsmaatschappij NV	0.13%	06/05/2022	487	578,177	0.1
				5,757,285	1.1
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	2.75%	05/19/2023	1,316	1,636,239	0.3
Telstra Corp. Ltd.	4.80%	10/12/2021	USD 1,426	1,433,361	0.3
				3,069,600	0.6
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
American Honda Finance Corp.	2.63%	10/14/2022	GBP 838	1,180,128	0.2
Daimler International Finance BV	2.63%	04/07/2025	EUR 1,092	1,417,833	0.3
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	4.05%	02/04/2022	USD 439	445,272	0.1
Hyundai Capital America	2.85%	11/01/2022	1,542	1,582,616	0.3
Volkswagen Leasing GmbH	1.13%	04/04/2024	EUR 1,891	2,299,869	0.4
				6,925,718	1.3
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AbbVie, Inc.	1.38%	05/17/2024	1,521	1,863,587	0.3
Amgen, Inc.	1.25%	02/25/2022	2,062	2,444,081	0.5
Anheuser-Busch InBev SA/NV	9.75%	07/30/2024	GBP 356	614,384	0.1
Anheuser-Busch InBev Worldwide, Inc.(a)	1.00%	09/06/2022	AUD 2,496	1,836,779	0.3
Asahi Group Holdings Ltd.	0.16%	10/23/2024	EUR 1,960	2,332,349	0.4
AstraZeneca PLC	0.75%	05/12/2024	1,089	1,317,563	0.2
Baxter International, Inc.	0.40%	05/15/2024	1,300	1,559,977	0.3
Baxter International, Inc.	1.30%	05/30/2025	375	464,889	0.1
Bayer AG	0.38%	07/06/2024	1,365	1,633,489	0.3
Becton Dickinson and Co.	0.00%	08/13/2023	733	868,723	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Cargill, Inc.	2.50%	02/15/2023	EUR 1,160	\$ 1,426,589	0.3%
DH Europe Finance SARL(a)	0.00%	06/30/2022	2,067	2,446,873	0.5
Diageo Finance PLC	0.13%	10/12/2023	1,355	1,613,780	0.3
GlaxoSmithKline Capital PLC	0.13%	05/12/2023	2,145	2,554,046	0.5
Heineken NV	3.40%	04/01/2022	USD 1,462	1,488,063	0.3
Medtronic Global Holdings SCA.	0.38%	03/07/2023	EUR 1,743	2,081,046	0.4
				<u>26,546,218</u>	<u>5.0</u>
ENERGIE					
BG Energy Capital PLC.	4.00%	10/15/2021	USD 858	861,566	0.2
BP Capital Markets PLC	1.88%	04/07/2024	EUR 1,808	2,250,727	0.4
Exxon Mobil Corp.	0.14%	06/26/2024	2,042	2,434,690	0.5
Kinder Morgan, Inc.(a)	1.41%	01/15/2023	USD 1,838	1,862,971	0.3
Repsol International Finance BV.	0.13%	10/05/2024	EUR 1,462	1,741,641	0.3
TotalEnergies Capital International SA.	2.13%	03/15/2023	1,852	2,273,430	0.4
				<u>11,425,025</u>	<u>2.1</u>
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	2.88%	07/06/2022	USD 1,404	1,428,896	0.3
Fidelity National Information Services, Inc.	0.75%	05/21/2023	EUR 1,986	2,382,888	0.4
Fiserv, Inc.	0.38%	07/01/2023	1,223	1,459,328	0.3
Honeywell International, Inc.	0.00%	03/10/2024	455	540,857	0.1
Honeywell International, Inc.	1.30%	02/22/2023	2,223	2,689,668	0.5
International Business Machines Corp.	0.38%	01/31/2023	2,028	2,420,199	0.5
				<u>10,921,836</u>	<u>2.1</u>
				<u>65,690,156</u>	<u>12.4</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	1.25%	05/28/2025	1,560	1,929,014	0.4
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series G	1.13%	02/28/2024	1,657	2,020,673	0.4
Banco Santander SA	2.75%	09/12/2023	GBP 1,852	2,646,196	0.5
Bank of America Corp.	1.38%	02/07/2025	EUR 2,067	2,530,738	0.5
Bank of Nova Scotia (The)	1.38%	12/05/2023	GBP 1,125	1,572,557	0.3
Barclays PLC	0.75%	06/09/2025	EUR 1,152	1,386,192	0.3
BNP Paribas SA.	1.13%	08/28/2024	1,852	2,269,352	0.4
BPCE SA	0.63%	09/26/2024	1,560	1,880,840	0.3
CaixaBank SA	1.00%	06/25/2024	1,170	1,421,502	0.3
Citigroup, Inc.	1.75%	01/28/2025	1,482	1,857,543	0.3
Credit Suisse Group AG.	1.25%	07/17/2025	1,526	1,855,459	0.3
Danske Bank A/S	3.00%	09/20/2022	USD 2,052	2,069,822	0.4
Deutsche Bank AG.	3.88%	02/12/2024	GBP 1,072	1,570,579	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The)	2.13%	09/30/2024	EUR 1,648	2,073,455	0.4
Intesa Sanpaolo SpA	3.13%	07/14/2022	USD 1,721	1,759,975	0.3
JPMorgan Chase & Co.	1.50%	01/27/2025	EUR 1,557	1,938,574	0.4
Lloyds Banking Group PLC	0.63%	01/15/2024	1,682	2,008,148	0.4
Morgan Stanley, Series G.	1.75%	03/11/2024	1,724	2,135,053	0.4
Santander UK Group Holdings PLC	3.57%	01/10/2023	USD 1,316	1,330,726	0.2
Societe Generale SA	1.25%	02/15/2024	EUR 1,560	1,904,302	0.3
Standard Chartered PLC	2.74%	09/10/2022	USD 1,884	1,885,206	0.3
Swedbank AB.	0.25%	10/09/2024	EUR 1,628	1,944,165	0.4
Toronto-Dominion Bank (The)	0.38%	04/25/2024	2,057	2,466,150	0.5
UBS Group AG	2.13%	03/04/2024	1,121	1,400,681	0.3
UniCredit SpA	3.75%	04/12/2022	USD 1,418	1,445,242	0.3
Wells Fargo & Co.	1.34%	05/04/2025	EUR 1,745	2,135,113	0.4
				<u>49,437,257</u>	<u>9.3</u>
FINANZEN					
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	USD 758	812,940	0.1
JAB Holdings BV	1.25%	05/22/2024	EUR 1,267	1,549,678	0.3
				<u>2,362,618</u>	<u>0.4</u>
VERSICHERUNGEN					
Berkshire Hathaway, Inc.	0.63%	01/17/2023	2,086	2,493,412	0.5
Metropolitan Life Global Funding I	0.00%	09/23/2022	1,000	1,186,551	0.2
Metropolitan Life Global Funding I, Series G.	2.63%	12/05/2022	GBP 1,141	1,611,377	0.3
				<u>5,291,340</u>	<u>1.0</u>
REITs					
Digital Dutch Finco BV	0.63%	07/15/2025	EUR 1,106	1,335,963	0.3
				<u>58,427,178</u>	<u>11.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
E.ON International Finance BV	5.63%	12/06/2023	GBP 1,121	\$ 1,711,332	0.3%
EDP Finance BV, Series E	8.63%	01/04/2024	926	1,502,807	0.3
Electricite de France SA	3.88%	01/18/2022	EUR 780	935,955	0.2
Enel Finance International NV	0.00%	06/17/2024	1,004	1,193,604	0.2
Enel Finance International NV	2.65%	09/10/2024	USD 1,209	1,271,955	0.2
Engie SA	0.38%	02/28/2023	EUR 2,047	2,439,524	0.5
Scottish Power UK PLC	6.75%	05/29/2023	GBP 1,014	1,541,340	0.3
Western Power Distribution East Midlands PLC	5.25%	01/17/2023	1,474	2,152,765	0.4
				<u>12,749,282</u>	<u>2.4</u>
ERDGAS					
Southern Gas Networks PLC	4.88%	10/05/2023	1,155	1,723,012	0.3
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Thames Water Utilities Finance PLC	1.88%	01/24/2024	344	485,430	0.1
Veolia Environnement SA	0.31%	10/04/2023	EUR 877	1,047,165	0.2
				<u>1,532,595</u>	<u>0.3</u>
				<u>16,004,889</u>	<u>3.0</u>
				<u>140,122,223</u>	<u>26.4</u>
INFLATIONSgebundene Wertpapiere					
FRANKREICH					
French Republic Government Bond OAT, Series OATE	0.10%	03/01/2026	14,704	19,044,552	3.6
DEUTSCHLAND					
Deutsche Bundesrepublik Inflation Linked Bond	0.10%	04/15/2026	8,504	11,094,063	2.1
				<u>30,138,615</u>	<u>5.7</u>
GEDECKTE ANLEIHEN					
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	0.45%	11/22/2023	2,622	3,156,859	0.6
Bank of Nova Scotia (The)	0.38%	10/23/2023	1,882	2,261,587	0.4
BPCE SFH SA	2.38%	11/29/2023	2,047	2,573,284	0.5
CaixaBank SA	1.00%	02/08/2023	2,340	2,820,564	0.6
DNB Boligkredit AS	0.38%	11/20/2024	2,236	2,709,492	0.5
Korea Housing Finance Corp.	0.10%	06/18/2024	1,857	2,218,478	0.4
National Bank of Canada	0.25%	07/24/2023	868	1,038,774	0.2
Royal Bank of Canada	0.25%	01/29/2024	2,255	2,707,617	0.5
Sumitomo Mitsui Banking Corp.	0.55%	11/06/2023	1,886	2,270,325	0.4
Westpac Banking Corp., Series G	0.50%	05/17/2024	2,157	2,610,111	0.5
				<u>24,367,091</u>	<u>4.6</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABLEN ZINSSATZ					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-3A, Class M1B(a)	1.93%	10/25/2028	USD 527	527,353	0.1
Series 2019-3A, Class M1B(a)	1.68%	07/25/2029	782	784,618	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2014-DN3, Class M3(a)	4.08%	08/25/2024	519	529,229	0.1
Series 2014-HQ2, Class M3(a)	3.83%	09/25/2024	833	858,639	0.2
Series 2015-DNA2, Class M3(a)	3.98%	12/25/2027	367	371,454	0.1
Series 2016-DNA2, Class M3(a)	4.73%	10/25/2028	1,440	1,495,517	0.3
Series 2016-DNA4, Class M3(a)	3.88%	03/25/2029	1,648	1,700,021	0.3
Series 2017-DNA1, Class M2(a)	3.33%	07/25/2029	362	372,103	0.1
Series 2017-DNA2, Class M2(a)	3.53%	10/25/2029	468	483,762	0.1
Series 2017-DNA3, Class M2(a)	2.58%	03/25/2030	1,327	1,353,431	0.3
Series 2021-DNA5, Class M2(a)	1.70%	01/25/2034	314	316,079	0.1
Federal National Mortgage Association					
Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	4.98%	11/25/2024	960	988,012	0.2
Series 2014-C04, Class 2M2(a)	5.08%	11/25/2024	524	534,687	0.1
Series 2015-C03, Class 2M2(a)	5.08%	07/25/2025	51	51,447	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(a)	6.08%	09/25/2028	747	781,790	0.1
Series 2016-C03, Class 1M2(a)	5.38%	10/25/2028	911	957,450	0.2
Series 2016-C05, Class 2M2(a)	4.53%	01/25/2029	782	811,841	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(a)	4.33%	04/25/2029	1,553	1,603,902	0.3
Home Re Ltd., Series 2019-1, Class M1(a)	1.73%	05/25/2029	672	672,351	0.1
Mortgage Insurance-Linked Notes, Series 2021-3,					
Class M1A(a)	1.95%	02/25/2034	731	731,486	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2019-2R, Class A(a)	2.84%	05/27/2023	632	625,951	0.1
Radnor Re Ltd., Series 2019-2, Class M1B(a)	1.83%	06/25/2029	2,346	2,350,660	0.4
				<u>18,901,783</u>	<u>3.5</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
GEMEINDEVERWALTUNG – KOMMUNALANLEIHEN					
KANADA					
Hydro-Quebec, Series HX	10.50%	10/15/2021	CAD 7,799	\$ 6,255,533	1.2%
Province of British Columbia Canada	4.25%	11/27/2024	AUD 4,553	3,715,888	0.7
Province of Ontario Canada, Series HC	9.50%	07/13/2022	CAD 2,925	2,500,390	0.5
Province of Ontario Canada, Series HP	8.10%	09/08/2023	2,096	1,912,424	0.3
Province of Quebec Canada	9.38%	01/16/2023	2,827	2,514,807	0.5
				<u>16,899,042</u>	<u>3.2</u>
QUASI-STAAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
CHILE					
Corp. Nacional del Cobre de Chile	2.25%	07/09/2024	EUR 1,223	1,534,723	0.3
CHINA					
Export-Import Bank of China (The)	0.75%	06/08/2022	1,769	2,102,673	0.4
Sinopec Group Overseas Development 2015 Ltd.	1.00%	04/28/2022	1,375	1,636,018	0.3
State Grid Overseas Investment 2016 Ltd.	1.25%	05/19/2022	1,102	1,312,354	0.3
				<u>5,051,045</u>	<u>1.0</u>
SÜDKOREA					
Export-Import Bank of Korea, Series 5FRN(a)	1.00%	01/25/2022	USD 2,320	2,326,544	0.4
Korea Development Bank (The)	1.50%	08/29/2024	AUD 2,730	2,036,906	0.4
				<u>4,363,450</u>	<u>0.8</u>
				<u>10,949,218</u>	<u>2.1</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Bain Capital Credit CLO Ltd. Series 2021-4A, Class A1 (a)	1.29%	10/20/2034	1,115	1,115,261	0.2
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. Series 2021-43A, Class A (a)	1.24%	07/17/2035	1,630	1,630,986	0.3
New Mountain CLO Ltd. Series CLO-3A, Class A (a)	1.31%	10/20/2034	992	992,273	0.2
				<u>3,738,520</u>	<u>0.7</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
INDONESIEN					
Indonesia Government International Bond	2.15%	07/18/2024	EUR 1,326	1,651,385	0.3
PHILIPPINEN					
Philippine Government International Bond	0.00%	02/03/2023	999	1,181,561	0.2
SÜDKOREA					
LG Display Co., Ltd.	3.88%	11/15/2021	USD 530	533,444	0.1
				<u>3,366,390</u>	<u>0.6</u>
REGIERUNGEN – STAATLICHE BEHÖRDEN					
JAPAN					
Development Bank of Japan, Inc., Series G	0.01%	10/15/2024	EUR 2,423	2,890,243	0.5
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
MSCG Trust, Series 2018-SELF, Class A(a)	1.00%	10/15/2037	USD 1,347	1,348,670	0.3
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-C8, Class B	3.98%	10/15/2045	1,078	1,095,080	0.2
				<u>2,443,750</u>	<u>0.5</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
ENERGIE					
Occidental Petroleum Corp.(a)	1.57%	08/15/2022	1,688	1,683,311	0.3
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	09/01/2029	1	643	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 1999	7.00%	10/01/2029	2	1,933	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2000	7.00%	12/01/2030	1	936	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	05/01/2031	0*	344	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	09/01/2031	8	10,212	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	11/01/2031	3	3,739	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	12/01/2031	8	8,574	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2001	7.00%	01/01/2032	1	1,736	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2002	7.00%	02/01/2032	2	2,142	0.0
				<u>30,259</u>	<u>0.0</u>
				<u>503,077,747</u>	<u>94.7</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO Ltd. Series 2021-12A, Class A1 (a)	1.29%	07/20/2034	USD 1,604	\$ 1,605,601	0.3%
Apidos CLO XXXIII Series 2020-33A, Class A (a)	1.83%	07/24/2031	1,251	1,250,552	0.2
Ballyrock CLO Ltd. Series 2021-16A, Class A1 (a)	1.26%	07/20/2034	1,079	1,079,469	0.2
Black Diamond CLO Ltd. Series 2019-2A, Class A1A (a)	1.57%	07/23/2032	1,435	1,434,648	0.3
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd. Series 2021-42A, Class A (a)	1.24%	07/16/2035	1,398	1,398,034	0.3
				<u>6,768,304</u>	<u>1.3</u>
Gesamtanlagen				<u>\$ 509,846,051</u>	<u>96.0%</u>
(Kosten \$518,277,190)					
Termineinlagen					
ANZ, London(b)	(0.13)%	–		69,375	0.0
Bank of Nova Scotia, Toronto(b)	0.01 %	–		158,266	0.0
BBH, Grand Cayman(b)	4.00 %	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	(0.08)%	–		53,543	0.0
BNP Paribas, Paris(b)	0.01 %	–		53,633	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(b)	0.00 %	–		165	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(b)	(0.78)%	–		292,952	0.1
SEB, Stockholm(b)	(0.26)%	–		493	0.0
SEB, Stockholm(b)	0.01 %	–		10,267,286	1.9
Sumitomo, London(b)	0.00 %	–		53,112	0.0
Sumitomo, London(b)	0.01 %	–		71,124	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>11,019,950</u>	<u>2.0</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>10,418,340</u>	<u>2.0</u>
Nettovermögen				<u>\$ 531,284,341</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Long					
Korea 3 Yr Bond Futures	09/17/2021	265	\$ 25,234,512	\$ 25,278,277	\$ 43,765
Short					
Euro-BOBL Futures	09/08/2021	644	102,006,087	102,694,472	(688,385)
Euro-Schatz Futures	09/08/2021	155	20,527,851	20,549,814	(21,963)
					<u>\$ (666,583)</u>
				Wertsteigerung	\$ 43,765
				Wertminderung	\$ (710,348)

DEVISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Australia and New Zealand Banking Group Ltd.	JPY 192,964	USD 1,748	11/15/2021	\$ (7,360)
Bank of America, NA.	RUB 317,262	USD 4,249	09/30/2021	(65,406)
Bank of America, NA.	USD 1,310	RUB 96,797	09/30/2021	6,685
Bank of America, NA.	JPY 1,200,253	USD 10,902	10/15/2021	(11,532)
BNP Paribas SA.	EUR 64,848	USD 79,514	09/09/2021	2,935,629
BNP Paribas SA.	USD 5,285	NZD 7,597	10/15/2021	68,058
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 1,971	EUR 1,667	09/09/2021	(2,092)
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 1,479,130	USD 13,517	09/30/2021	68,318
Brown Brothers Harriman & Co.	CHF 2,514	USD 2,789	10/28/2021	38,992
Brown Brothers Harriman & Co.	EUR 40,316	USD 47,909	10/29/2021	251,877
Brown Brothers Harriman & Co.	USD 545	EUR 464	11/08/2021	3,128
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 754,782	USD 6,885	11/17/2021	19,561
Brown Brothers Harriman & Co.	JPY 2,313,061	USD 21,008	11/30/2021	(32,284)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 15,306	AUD 21,131	10/01/2021	155,345
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,710	CAD 8,522	10/01/2021	43,922
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 18,347	EUR 15,616	10/01/2021	103,685
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 9,768	GBP 7,124	10/01/2021	26,879
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 665	NZD 959	10/01/2021	10,168
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,377	SGD 1,861	10/01/2021	7,793
Citibank, NA	CNH 2,194	USD 337	09/16/2021	(2,589)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Citibank, NA	USD 1,120	EUR 952	11/08/2021	\$ 5,480
Citibank, NA	AUD 36,417	USD 26,244	11/09/2021	(406,285)
Citibank, NA	EUR 6,660	USD 7,847	11/30/2021	(30,047)
Deutsche Bank AG	EUR 40,834	USD 48,284	10/15/2021	27,327
Goldman Sachs Bank USA	CAD 5,004	USD 3,886	09/24/2021	(80,065)
Goldman Sachs Bank USA	GBP 13,660	USD 18,735	11/10/2021	(46,899)
HSBC Bank USA	CNH 7,725	USD 1,186	09/16/2021	(9,726)
Morgan Stanley & Co., Inc.	CNH 21,843	USD 3,362	09/16/2021	(16,587)
Morgan Stanley & Co., Inc.	CAD 21,950	USD 17,612	09/24/2021	214,660
Morgan Stanley & Co., Inc.	KRW 1,617,590	USD 1,418	10/28/2021	23,467
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 31,040	USD 36,749	09/23/2021	82,561
Royal Bank of Scotland PLC	EUR 9,719	USD 11,426	11/08/2021	(65,499)
UBS AG	USD 2,651	CAD 3,382	09/24/2021	30,079
UBS AG	RUB 197,705	USD 2,621	09/30/2021	(67,696)
UBS AG	CHF 2,269	USD 2,511	10/28/2021	29,650
UBS AG	MXN 103,602	USD 5,054	10/28/2021	(64,100)
				\$ 3,245,097
			Wertsteigerung	\$ 4,153,264
			Wertminderung	\$ (908,167)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	CNY 43,870	05/07/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	1.830%	\$ (122,078)
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	41,861	07/22/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.510%	37,757
Citigroup Global Markets, Inc./(LCH Group)	75,241	07/21/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.585%	100,344
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	42,446	09/01/2025	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.748%	97,285
Morgan Stanley & Co. LLC/(LCH Group)	57,411	12/02/2024	China 7-Day Reverse Repo Rate	2.938%	174,620
Insgesamt					\$ 287,928
				Wertsteigerung	\$ 410,006
				Wertminderung	\$ (122,078)

* Kapitalbetrag geringer als 500.

(a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. August 2021.

(b) Tagesgeld.

Währungskürzel:

AUD	- Australian Dollar
CAD	- Canadian Dollar
CHF	- Swiss Franc
CNH	- Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
CNY	- Chinese Yuan Renminbi
EUR	- Euro
GBP	- Great British Pound
JPY	- Japanese Yen
KRW	- South Korean Won
MXN	- Mexican Peso
NZD	- New Zealand Dollar
RUB	- Russian Ruble
SGD	- Singapore Dollar
USD	- United States Dollar

Glossar:

BOBL – Bundesobligationen

CLO – Collateralized Loan Obligations

CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities

LCH – London Clearing House

OAT – Obligations Assimilables du Trésor

REIT – Real Estate Investment Trust

	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 2,804	\$ 2,924,554	0.0%
Avient Corp.	5.75%	05/15/2025	7,156	7,550,526	0.0
Big River Steel LLC/BRS Finance Corp.	6.63%	01/31/2029	23,400	25,531,118	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.63%	03/01/2029	8,053	8,506,365	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	4.88%	03/01/2031	8,434	9,066,564	0.1
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	2,020	2,166,147	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025	14,805	17,235,648	0.1
CVR Partners LP/CVR Nitrogen Finance Corp.	6.13%	06/15/2028	14,545	14,878,289	0.1
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.38%	04/01/2031	1,000	1,075,031	0.0
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	3,648	3,958,792	0.0
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	11,724	14,570,687	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.45%	03/15/2043	16,385	20,960,292	0.1
Graham Packaging Co., Inc.	7.13%	08/15/2028	6,383	6,796,605	0.0
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.	7.38%	12/15/2023	12,839	13,037,747	0.1
Hecla Mining Co.	7.25%	02/15/2028	25,670	27,800,659	0.1
Illuminate Buyer LLC/Illuminate Holdings IV, Inc.	9.00%	07/01/2028	19,086	21,085,699	0.1
Intelligent Packaging Holdco Issuer LP(a)	9.00%	01/15/2026	12,133	12,606,611	0.1
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	29,516	30,841,929	0.2
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	8.50%	08/01/2028	7,758	8,646,500	0.0
Mercer International, Inc.	5.13%	02/01/2029	20,091	20,244,345	0.1
Olin Corp.	5.00%	02/01/2030	1,000	1,073,584	0.0
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	19,555	21,595,373	0.1
Peabody Energy Corp.(a)	8.50%	12/31/2024	1,677	1,332,088	0.0
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.	10.00%	12/31/2024	1,871	1,861,645	0.0
SCIH Salt Holdings, Inc.	6.63%	05/01/2029	1,000	982,975	0.0
United States Steel Corp.	6.25%	03/15/2026	10,974	11,311,287	0.1
Valvoline, Inc.	3.63%	06/15/2031	1,000	995,006	0.0
Valvoline, Inc.	4.25%	02/15/2030	24,506	25,436,145	0.1
WR Grace & Co.-Conn	4.88%	06/15/2027	4,463	4,630,470	0.0
WR Grace Holdings LLC	5.63%	08/15/2029	16,573	17,252,677	0.1
				<u>355,955,358</u>	<u>1.7</u>
INVESTITIONSGÜTER					
ARD Finance SA(a)	5.00%	06/30/2027	EUR 19,306	23,490,082	0.1
ARD Finance SA(a)	6.50%	06/30/2027	USD 21,828	22,958,619	0.1
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	08/15/2027	1,000	1,030,000	0.0
Bombardier, Inc.	7.50%	12/01/2024	16,280	16,979,860	0.1
Bombardier, Inc.	7.50%	03/15/2025	42,769	43,957,956	0.2
Bombardier, Inc.	7.88%	04/15/2027	541	567,284	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	2,611	2,860,573	0.0
Cleaver-Brooks, Inc.	7.88%	03/01/2023	13,689	13,483,453	0.1
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026	705	741,212	0.0
Covanta Holding Corp.	5.88%	07/01/2025	3,000	3,104,471	0.0
EnerSys	4.38%	12/15/2027	18,085	19,002,423	0.1
F-Brasile SpA/F-Brasile US LLC, Series XR	7.38%	08/15/2026	20,200	20,884,626	0.1
Gates Global LLC/Gates Corp.	6.25%	01/15/2026	25,892	27,024,775	0.1
GFL Environmental, Inc.	3.50%	09/01/2028	1,000	997,988	0.0
GFL Environmental, Inc.	4.75%	06/15/2029	18,492	19,011,361	0.1
Granite US Holdings Corp.	11.00%	10/01/2027	27,965	31,066,649	0.2
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	27,481	29,210,275	0.1
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	2,036	2,069,452	0.0
Madison IAQ LLC	5.88%	06/30/2029	46,603	47,704,997	0.2
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	7,075	7,292,210	0.0
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	EUR 8,798	10,876,156	0.1
Summit Materials LLC/Summit Materials Finance Corp.	5.25%	01/15/2029	USD 3,336	3,529,259	0.0
Tervita Corp.	11.00%	12/01/2025	21,738	25,073,157	0.1
Titan Holdings II BV	5.13%	07/15/2029	EUR 7,122	8,556,478	0.0
TK Vertical US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	USD 15,684	16,563,665	0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	7,229	7,314,813	0.0
Triumph Group, Inc.	7.75%	08/15/2025	8,167	8,176,537	0.0
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	13,111	14,445,116	0.1
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	EUR 1,566	1,886,300	0.0
Vertical Holdco GmbH	7.63%	07/15/2028	USD 7,893	8,563,376	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	31,560	33,941,829	0.2
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	10,669	11,877,467	0.1
				<u>484,242,419</u>	<u>2.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	USD 36,810	\$ 38,545,882	0.2%
Altice Financing SA	5.75%	08/15/2029	71,920	73,741,526	0.4
Arches Buyer, Inc.	6.13%	12/01/2028	8,568	8,820,314	0.0
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	6,056	6,215,898	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.25%	01/15/2034	22,642	22,842,946	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	21,000	21,961,595	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.00%	02/01/2028	1,000	1,047,935	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	5.75%	02/15/2026	245	252,044	0.0
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	21,181	21,791,660	0.1
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	18,328	18,291,064	0.1
CSC Holdings LLC	5.38%	02/01/2028	1,000	1,059,728	0.0
CSC Holdings LLC	5.50%	04/15/2027	6,197	6,489,366	0.0
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	23,212	24,522,825	0.1
CSC Holdings LLC	6.50%	02/01/2029	1,000	1,103,695	0.0
CSC Holdings LLC	7.50%	04/01/2028	17,996	19,747,303	0.1
DISH DBS Corp.	5.00%	03/15/2023	36,424	38,031,820	0.2
DISH DBS Corp.	5.13%	06/01/2029	11,838	11,784,880	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	2,544	2,749,207	0.0
Gray Television, Inc.	5.88%	07/15/2026	2,000	2,065,237	0.0
Gray Television, Inc.	7.00%	05/15/2027	1,000	1,072,642	0.0
iHeartCommunications, Inc.	4.75%	01/15/2028	6,435	6,676,447	0.0
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	5,448	5,712,705	0.0
iHeartCommunications, Inc.	6.38%	05/01/2026	2,630	2,779,723	0.0
iHeartCommunications, Inc.	8.38%	05/01/2027	4,768	5,061,073	0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	2,301	2,456,758	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	52,857	56,334,910	0.3
Liberty Interactive LLC(b)	3.75%	02/15/2030	11,937	9,191,670	0.1
Liberty Interactive LLC	8.25%	02/01/2030	3,000	3,383,399	0.0
Mav Acquisition Corp.	5.75%	08/01/2028	38,388	38,299,708	0.2
Mav Acquisition Corp.	8.00%	08/01/2029	20,010	19,659,825	0.1
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026	44,314	46,013,498	0.2
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	6,800	5,103,985	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	12,566	11,058,879	0.1
Netflix, Inc.	4.88%	06/15/2030	1,000	1,197,560	0.0
Netflix, Inc.	5.88%	11/15/2028	33,984	42,177,889	0.2
Outfront Media Capital LLC/Outfront Media Capital Corp.	4.63%	03/15/2030	10,335	10,462,840	0.1
Scripps Escrow II, Inc.	3.88%	01/15/2029	1,000	1,004,987	0.0
Scripps Escrow II, Inc.	5.38%	01/15/2031	9,519	9,425,779	0.1
Scripps Escrow, Inc.	5.88%	07/15/2027	12,381	12,704,446	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	21,660	21,213,722	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.88%	03/15/2026	895	915,838	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	4.00%	07/15/2028	58,351	59,637,833	0.3
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	1,000	1,094,403	0.0
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	6,800	6,913,279	0.0
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	EUR 19,048	23,562,468	0.1
TEGNA, Inc.	4.75%	03/15/2026	USD 4,806	5,108,231	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	18,735	19,847,775	0.1
TEGNA, Inc.	5.50%	09/15/2024	1,242	1,256,533	0.0
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	5,371	5,448,200	0.0
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025	1,681	1,709,388	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	29,088	31,507,063	0.2
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025	13,167	14,357,282	0.1
UPC Holding BV	5.50%	01/15/2028	52,055	54,799,846	0.3
Urban One, Inc.	7.38%	02/01/2028	49,053	53,092,308	0.3
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	4,000	4,058,042	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027	GBP 2,000	2,861,302	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	5.50%	05/15/2029	USD 1,952	2,091,228	0.0
Virgin Media Vendor Financing Notes IV DAC	5.00%	07/15/2028	1,000	1,036,360	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	4,484	4,606,648	0.0
Ziggo Bond Co. BV	6.00%	01/15/2027	2,820	2,950,540	0.0
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027	18,376	19,054,786	0.1
				<u>947,966,723</u>	<u>4.6</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026	5,204	5,411,158	0.0
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	8,421	9,137,390	0.0
Arqiva Broadcast Finance PLC	6.75%	09/30/2023	GBP 6,698	9,407,948	0.0
Connect Finco SARL/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	USD 40,626	42,149,475	0.2
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	5,735	5,919,722	0.0
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	24,110	26,369,016	0.1
DKT Finance ApS	7.00%	06/17/2023	EUR 8,954	10,772,078	0.1
DKT Finance ApS	9.38%	06/17/2023	USD 23,497	23,983,771	0.1
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	35,665	37,594,234	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Frontier Communications Holdings LLC	5.88%	10/15/2027	USD 16,401	\$ 17,496,724	0.1%
Frontier Communications Holdings LLC	6.75%	05/01/2029	14,848	15,889,004	0.1
Hughes Satellite Systems Corp.	6.63%	08/01/2026	13,000	14,775,534	0.1
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	5.50%	08/01/2023	33,777	17,999,732	0.1
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	8.50%	10/15/2024	2,575	1,415,650	0.0
Intelsat Jackson Holdings SA(c)	9.75%	07/15/2025	2,000	1,082,439	0.0
Intrado Corp.	8.50%	10/15/2025	13,711	13,197,596	0.1
Lumen Technologies, Inc.	5.63%	04/01/2025	1,000	1,082,758	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series P	7.60%	09/15/2039	1,567	1,746,657	0.0
Lumen Technologies, Inc., Series T	5.80%	03/15/2022	1,492	1,527,645	0.0
Lumen Technologies, Inc.	5.38%	06/15/2029	18,629	19,138,827	0.1
Nexstar Broadcasting, Inc.	5.63%	07/15/2027	11,783	12,509,646	0.1
Sprint Capital Corp.	8.75%	03/15/2032	455	697,405	0.0
Sprint Corp.	7.13%	06/15/2024	1,000	1,151,148	0.0
Sprint Corp.	7.63%	02/15/2025	3,000	3,551,724	0.0
Sprint Corp.	7.63%	03/01/2026	8,328	10,269,574	0.1
Sprint Corp.	7.88%	09/15/2023	25,000	28,309,324	0.1
Telecom Italia Capital SA	6.00%	09/30/2034	2,000	2,273,658	0.0
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	31,658	39,793,649	0.2
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	13,001	16,903,418	0.1
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	42,248	43,405,643	0.2
Zayo Group Holdings, Inc.	6.13%	03/01/2028	39,711	40,414,790	0.2
				<u>475,377,337</u>	<u>2.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025	39,045	42,541,131	0.2
Allison Transmission, Inc.	5.88%	06/01/2029	7,094	7,812,278	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	04/01/2025	9,162	9,466,532	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	03/15/2026	4,000	4,122,830	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	8,019	8,427,093	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	15,455	16,691,319	0.1
Aston Martin Capital Holdings Ltd.	10.50%	11/30/2025	33,751	37,696,442	0.2
Aston Martin Capital Holdings Ltd.(a)	15.00%	11/30/2026	27,808	31,624,306	0.2
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	EUR 3,111	3,802,005	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	USD 5,621	5,933,150	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	8.50%	05/15/2027	37,834	40,386,502	0.2
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	232	245,104	0.0
Dana, Inc.	5.63%	06/15/2028	3,358	3,611,436	0.0
Dealer Tire LLC/DT Issuer LLC	8.00%	02/01/2028	34,435	36,779,516	0.2
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023	32,333	35,775,773	0.2
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025	10,929	13,317,437	0.1
Ford Motor Credit Co. LLC	4.38%	08/06/2023	500	522,359	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	6,459	6,836,053	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.25%	07/15/2031	5,865	6,275,402	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a)	3.75%	09/15/2026	EUR 1,111	1,338,178	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.00%	05/15/2027	USD 15,335	16,053,306	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(a)	6.38%	05/15/2029	15,335	16,699,190	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	2.20%	01/15/2024	EUR 3,000	3,528,885	0.0
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.50%	07/15/2029	USD 9,297	9,170,462	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	EUR 8,244	10,573,290	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	USD 28,297	29,192,713	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	24,649	26,943,978	0.1
Mclaren Finance PLC	7.50%	08/01/2026	33,622	33,565,170	0.2
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	7,776	8,269,055	0.0
PM General Purchaser LLC	9.50%	10/01/2028	28,314	30,778,740	0.2
Real Hero Merger Sub 2, Inc.	6.25%	02/01/2029	7,889	8,162,708	0.0
Tenneco, Inc.	5.00%	07/15/2026	31,522	31,474,411	0.2
Tenneco, Inc.	5.13%	04/15/2029	2,000	2,074,189	0.0
Tenneco, Inc.	7.88%	01/15/2029	6,003	6,774,587	0.0
Titan International, Inc.	7.00%	04/30/2028	24,723	25,845,607	0.1
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	25,379	27,727,653	0.1
				<u>600,038,790</u>	<u>2.9</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	20,679	21,092,580	0.1
Carnival Corp.	9.88%	08/01/2027	13,439	15,522,045	0.1
Carnival Corp.	10.50%	02/01/2026	1,000	1,153,750	0.0
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023	30,960	34,817,979	0.2
Cedar Fair LP	5.25%	07/15/2029	2,000	2,046,049	0.0
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./Magnum Management Corp./Millennium Op	5.50%	05/01/2025	41,998	43,708,508	0.2
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	3,598	3,930,202	0.0
NCL Corp., Ltd.	10.25%	02/01/2026	3,000	3,463,694	0.0
NCL Corp., Ltd.	5.88%	03/15/2026	29,640	29,815,677	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	18,015	18,262,706	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	USD 13,254	\$ 13,320,270	0.1%
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	25,951	29,140,832	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	28,450	32,681,937	0.2
SeaWorld Parks & Entertainment, Inc.	8.75%	05/01/2025	19,206	20,760,662	0.1
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	7,239	7,743,986	0.0
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	6,640	7,070,313	0.0
Viking Cruises Ltd.	5.88%	09/15/2027	29,535	28,602,672	0.1
Viking Cruises Ltd.	7.00%	02/15/2029	7,971	8,020,612	0.0
Viking Cruises Ltd.	13.00%	05/15/2025	12,492	14,459,490	0.1
				<u>335,613,964</u>	<u>1.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	16,531	17,331,628	0.1
Bally's Corp.	6.75%	06/01/2027	21,077	22,816,474	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	21,605	22,319,724	0.1
Boyd Gaming Corp.	8.63%	06/01/2025	8,389	9,115,989	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	26,127	26,343,971	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	19,888	20,998,615	0.1
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	22,343	23,609,876	0.1
Churchill Downs, Inc.	5.50%	04/01/2027	2,000	2,081,204	0.0
CP Atlas Buyer, Inc.	7.00%	12/01/2028	16,319	16,691,734	0.1
Empire Communities Corp.	7.00%	12/15/2025	6,172	6,525,658	0.0
Everi Holdings, Inc.	5.00%	07/15/2029	3,865	3,955,325	0.0
Five Point Operating Co. LP/Five Point Capital Corp.	7.88%	11/15/2025	32,611	34,034,157	0.2
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp.	6.50%	07/15/2025	5,954	6,386,408	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025	5,320	5,581,908	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.75%	05/01/2028	5,733	6,196,496	0.0
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc	4.88%	07/01/2031	16,956	16,913,581	0.1
Hilton Grand Vacations Borrower Escrow LLC/Hilton Grand Vacations Borrower Esc	5.00%	06/01/2029	14,836	15,059,474	0.1
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,705	6,014,051	0.0
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	512	547,542	0.0
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	9,125	10,403,823	0.1
International Game Technology PLC	6.50%	02/15/2025	23,261	25,914,731	0.1
KB Home	4.80%	11/15/2029	5,544	6,155,600	0.0
KB Home	7.50%	09/15/2022	7,596	8,091,163	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	4.50%	06/15/2029	9,893	10,004,366	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	13,943	14,682,738	0.1
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC	6.50%	09/15/2026	13,889	14,358,085	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	27,097	27,781,991	0.1
MGM Resorts International	7.75%	03/15/2022	2,370	2,453,182	0.0
Premier Entertainment Sub LLC/Premier Entertainment Finance Corp.	5.63%	09/01/2029	20,595	21,091,222	0.1
Premier Entertainment Sub LLC/Premier Entertainment Finance Corp.	5.88%	09/01/2031	20,595	21,104,687	0.1
Scientific Games International, Inc.	3.38%	02/15/2026	EUR 1,111	1,316,369	0.0
Scientific Games International, Inc.	5.00%	10/15/2025	USD 6,488	6,674,402	0.0
Scientific Games International, Inc.	7.00%	05/15/2028	7,525	8,096,696	0.0
Scientific Games International, Inc.	8.25%	03/15/2026	11,000	11,706,073	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	10,577	10,903,161	0.1
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	04/01/2029	14,461	14,926,642	0.1
Standard Industries, Inc./NJ	4.38%	07/15/2030	1,000	1,030,247	0.0
Standard Industries, Inc./NJ	5.00%	02/15/2027	1,000	1,034,956	0.0
Sugarhouse HSP Gaming Prop Mezz LP/Sugarhouse HSP Gaming Finance Corp.	5.88%	05/15/2025	22,618	22,590,723	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	14,127	15,924,304	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	11,351	12,910,132	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc./Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.88%	04/15/2023	15,712	16,497,600	0.1
Travel plus Leisure Co.	6.00%	04/01/2027	4,000	4,422,986	0.0
Travel + Leisure Co.	4.63%	03/01/2030	15,276	15,763,931	0.1
Travel + Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	29,164	33,227,289	0.2
Victors Merger Corp.	6.38%	05/15/2029	38,070	37,855,678	0.2
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	4.25%	05/30/2023	1,667	1,711,300	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.25%	05/15/2027	3,000	3,150,720	0.0
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025	13,063	13,862,529	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	5,215	5,436,282	0.0
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.75%	04/15/2025	9,543	10,140,904	0.1
				<u>673,748,327</u>	<u>3.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
IRB Holding Corp.....	6.75%	02/15/2026	USD 45,629	\$ 47,164,949	0.2%
IRB Holding Corp.....	7.00%	06/15/2025	10,678	11,419,458	0.1
Yum! Brands, Inc.	7.75%	04/01/2025	8,625	9,291,342	0.0
				<u>67,875,749</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Bath & Body Works, Inc.....	5.25%	02/01/2028	3,551	3,978,063	0.0
Bath & Body Works, Inc.....	6.63%	10/01/2030	5,689	6,601,250	0.0
Bath & Body Works, Inc.....	6.75%	07/01/2036	11,880	15,140,115	0.1
Bath & Body Works, Inc.....	6.88%	11/01/2035	12,781	16,419,409	0.1
Bath & Body Works, Inc.....	6.95%	03/01/2033	13,864	16,747,603	0.1
Bath & Body Works, Inc.....	7.50%	06/15/2029	5,283	6,133,972	0.0
Bath & Body Works, Inc.....	7.60%	07/15/2037	4,421	5,572,919	0.0
Bath & Body Works, Inc.....	9.38%	07/01/2025	2,879	3,716,545	0.0
BCPE Ulysses Intermediate, Inc.(a)	7.75%	04/01/2027	9,973	9,874,320	0.1
Dufry One BV	2.50%	10/15/2024	EUR 17,530	20,463,524	0.1
Foundation Building Materials, Inc.	6.00%	03/01/2029	USD 5,396	5,310,875	0.0
LBM Acquisition LLC	6.25%	01/15/2029	7,137	7,177,848	0.0
Michaels Cos, Inc. (The)	7.88%	05/01/2029	57,224	58,756,102	0.3
Murphy Oil USA, Inc.	3.75%	02/15/2031	1,000	1,008,317	0.0
Murphy Oil USA, Inc.	5.63%	05/01/2027	1,441	1,515,814	0.0
NMG Holding Co., Inc./Neiman Marcus Group LLC.....	7.13%	04/01/2026	14,261	15,090,078	0.1
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.....	4.75%	02/15/2028	6,641	6,913,629	0.0
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.....	7.75%	02/15/2029	43,041	47,306,400	0.2
Rite Aid Corp.	7.50%	07/01/2025	22,144	22,754,025	0.1
Rite Aid Corp.	8.00%	11/15/2026	21,400	22,066,580	0.1
Sonic Automotive, Inc.	6.13%	03/15/2027	16,446	17,115,056	0.1
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp....	6.38%	09/30/2026	32,215	33,921,945	0.2
SRS Distribution, Inc.	6.13%	07/01/2029	6,009	6,236,927	0.0
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	656	664,558	0.0
Staples, Inc.	10.75%	04/15/2027	43,095	42,024,518	0.2
TPro Acquisition Corp.	11.00%	10/15/2024	16,176	17,708,562	0.1
White Cap Buyer LLC	6.88%	10/15/2028	29,658	31,556,092	0.2
White Cap Parent LLC(a)	8.25%	03/15/2026	7,186	7,441,157	0.1
William Carter Co. (The)	5.50%	05/15/2025	15,769	16,563,122	0.1
				<u>465,779,325</u>	<u>2.3</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC.....	4.63%	08/01/2029	1,000	1,002,477	0.0
AdaptHealth LLC.....	5.13%	03/01/2030	24,648	24,957,624	0.1
AdaptHealth LLC.....	6.13%	08/01/2028	5,430	5,809,340	0.0
AHP Health Partners, Inc.	5.75%	07/15/2029	20,045	20,267,706	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC.....	4.63%	01/15/2027	12,062	12,806,645	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC.....	4.88%	02/15/2030	7,984	8,719,461	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC.....	5.75%	03/15/2025	923	943,435	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC.....	5.88%	02/15/2028	1,000	1,072,955	0.0
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	15,514	16,681,826	0.1
Bausch Health Americas, Inc.	9.25%	04/01/2026	5,000	5,385,477	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	5.75%	08/15/2027	2,000	2,100,460	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.13%	04/15/2025	3,690	3,779,180	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	9,519	9,448,626	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	7.25%	05/30/2029	9,800	10,091,113	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	9.00%	12/15/2025	6,654	7,089,749	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	11,430	12,157,500	0.1
Chobani LLC/Chobani Finance Corp., Inc.....	7.50%	04/15/2025	2,000	2,081,368	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.....	5.63%	03/15/2027	7,408	7,817,235	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.....	6.00%	01/15/2029	7,082	7,549,511	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.....	6.13%	04/01/2030	17,452	17,592,517	0.1
CHS/Community Health Systems, Inc.....	6.63%	02/15/2025	6,930	7,288,891	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.....	6.88%	04/01/2028	2,000	1,984,366	0.0
CHS/Community Health Systems, Inc.....	6.88%	04/15/2029	35,534	36,910,943	0.2
DaVita, Inc.	4.63%	06/01/2030	2,000	2,089,661	0.0
Elanco Animal Health, Inc.	5.90%	08/28/2028	2,000	2,340,692	0.0
Endo Luxembourg Finance Co. I SARL/Endo US, Inc.....	6.13%	04/01/2029	2,000	1,967,627	0.0
Global Medical Response, Inc.	6.50%	10/01/2025	29,645	30,636,917	0.2
HCRX Investments Holdco LP	4.50%	08/01/2029	5,823	5,903,309	0.0
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc....	7.00%	12/31/2027	55,853	54,342,908	0.3
Legacy LifePoint Health LLC	6.75%	04/15/2025	1,667	1,759,648	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
LifePoint Health, Inc.	5.38%	01/15/2029	USD 3,000	\$ 2,950,305	0.0%
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC(c)	5.50%	04/15/2025	3,859	2,593,102	0.0
Mallinckrodt International Finance SA/Mallinckrodt CB LLC(c)	5.63%	10/15/2023	5,298	3,560,956	0.0
MEDNAX, Inc.	6.25%	01/15/2027	493	519,659	0.0
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	3,999	4,110,193	0.0
ModivCare, Inc.	5.88%	11/15/2025	3,735	3,978,991	0.0
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	5.13%	04/30/2031	29,727	31,179,514	0.2
Par Pharmaceutical, Inc.	7.50%	04/01/2027	6,263	6,344,300	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	18,298	19,608,137	0.1
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	3,097	3,259,786	0.0
Radiology Partners, Inc.	9.25%	02/01/2028	36,585	39,224,140	0.2
RegionalCare Hospital Partners Holdings, Inc./ LifePoint Health, Inc.	9.75%	12/01/2026	47,895	51,027,478	0.3
RP Escrow Issuer LLC	5.25%	12/15/2025	7,534	7,704,396	0.0
Tenet Healthcare Corp.	6.13%	10/01/2028	8,495	8,981,695	0.1
Tenet Healthcare Corp.	6.25%	02/01/2027	5,000	5,219,764	0.0
Tenet Healthcare Corp.	7.50%	04/01/2025	24,062	25,781,726	0.1
Triton Water Holdings, Inc.	6.25%	04/01/2029	16,820	16,632,676	0.1
US Acute Care Solutions LLC	6.38%	03/01/2026	4,043	4,203,980	0.0
US Renal Care, Inc.	10.63%	07/15/2027	35,766	37,558,643	0.2
Vizient, Inc.	6.25%	05/15/2027	4,262	4,466,479	0.0
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	5,687	5,948,637	0.0
				607,433,724	2.9
ENERGIE					
Antero Resources Corp.	5.00%	03/01/2025	4,000	4,083,643	0.0
Antero Resources Corp.	7.63%	02/01/2029	2,980	3,278,507	0.0
Antero Resources Corp.	8.38%	07/15/2026	13,544	15,351,669	0.1
Apache Corp.	4.25%	01/15/2030	10,000	10,763,390	0.1
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026	18,888	18,721,356	0.1
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	5,384	5,619,525	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	13,386	14,531,482	0.1
Bonanza Creek Energy, Inc.	7.50%	04/30/2026	968	971,676	0.0
Callon Petroleum, Co.	8.00%	08/01/2028	24,696	23,759,942	0.1
Callon Petroleum, Co.	8.25%	07/15/2025	6,693	6,411,591	0.0
Callon Petroleum, Co.	9.00%	04/01/2025	16,625	17,872,465	0.1
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	11,351	11,539,789	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	37,747	38,650,615	0.2
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	15,392	16,022,091	0.1
CNX Resources Corp.	7.25%	03/14/2027	3,321	3,520,260	0.0
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	7,503	7,513,018	0.0
Comstock Resources, Inc.	6.75%	03/01/2029	14,500	15,215,818	0.1
Comstock Resources, Inc.	7.50%	05/15/2025	3,753	3,881,734	0.0
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC	5.50%	06/15/2031	24,829	25,619,746	0.1
Diamond Foreign Asset Co./Diamond Finance LLC(a)	9.00%	04/22/2027	1,753	1,761,955	0.0
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045	1,692	1,809,129	0.0
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	28,449	28,528,047	0.1
EnLink Midstream LLC	5.63%	01/15/2028	23,392	24,539,839	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.15%	06/01/2025	1,667	1,714,814	0.0
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024	1,257	1,307,364	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045	12,856	11,791,204	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047	8,848	8,396,042	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	10,151	9,738,469	0.1
EQT Corp.	3.90%	10/01/2027	10,000	10,805,972	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	5.63%	06/15/2024	10,368	10,184,960	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.25%	05/15/2026	6,765	6,544,236	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	6.50%	10/01/2025	11,924	11,712,875	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	7.75%	02/01/2028	20,791	20,363,318	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.	8.00%	01/15/2027	16,614	16,512,899	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	6.88%	01/15/2029	8,328	8,637,984	0.0
Global Partners LP/GLP Finance Corp.	7.00%	08/01/2027	9,867	10,258,671	0.1
Gulfport Energy Operating Corp.	8.00%	05/17/2026	22,419	23,811,154	0.1
Hess Midstream Operations LP	4.25%	02/15/2030	13,259	13,429,831	0.1
Hess Midstream Operations LP	5.63%	02/15/2026	10,815	11,246,503	0.1
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	5.75%	02/01/2029	9,328	9,466,655	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.	6.00%	02/01/2031	12,329	12,660,963	0.1
Independence Energy Finance LLC	7.25%	05/01/2026	22,728	22,961,595	0.1
Indigo Natural Resources LLC	5.38%	02/01/2029	18,012	18,591,036	0.1
Ithaca Energy North Sea PLC	9.00%	07/15/2026	8,054	7,996,581	0.0
ITT Holdings LLC	6.50%	08/01/2029	41,373	42,218,338	0.2
Moss Creek Resources Holdings, Inc.	7.50%	01/15/2026	58,760	51,265,572	0.2
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	20,063	18,697,267	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028	20,724	18,852,763	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Neptune Energy Bondco PLC	6.63%	05/15/2025	USD 2,425	\$ 2,462,165	0.0%
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	35,027	35,542,635	0.2
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	47,040	47,718,349	0.2
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	6.13%	03/01/2025	2,000	1,656,779	0.0
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023	18,691	17,613,041	0.1
Occidental Petroleum Corp.	2.70%	02/15/2023	16,135	16,422,700	0.1
Occidental Petroleum Corp.	2.90%	08/15/2024	5,564	5,706,424	0.0
Occidental Petroleum Corp.	3.40%	04/15/2026	1,329	1,373,207	0.0
Occidental Petroleum Corp.	3.50%	06/15/2025	7,513	7,882,528	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.50%	12/01/2025	5,236	5,838,140	0.0
Occidental Petroleum Corp.	5.88%	09/01/2025	4,883	5,491,925	0.0
Occidental Petroleum Corp.	6.13%	01/01/2031	7,692	9,299,681	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.00%	07/15/2025	7,644	9,208,959	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.50%	07/15/2027	3,851	4,856,038	0.0
Occidental Petroleum Corp.	8.88%	07/15/2030	8,851	12,142,974	0.1
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.	9.25%	05/15/2025	21,954	21,187,579	0.1
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	16,387	17,025,978	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	13,322	13,547,251	0.1
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023	6,864	7,052,775	0.0
Range Resources Corp.	8.25%	01/15/2029	11,437	12,688,024	0.1
Renewable Energy Group, Inc.	5.88%	06/01/2028	3,857	3,994,711	0.0
SM Energy Co.	6.50%	07/15/2028	8,778	8,848,448	0.0
SM Energy Co.	6.63%	01/15/2027	2,000	2,010,147	0.0
SM Energy Co.	6.75%	09/15/2026	17,000	17,091,303	0.1
Southwestern Energy Co.	8.38%	09/15/2028	9,087	10,182,090	0.1
Sunnova Energy Corp.	5.88%	09/01/2026	12,285	12,374,802	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.	5.88%	03/15/2028	26,261	27,718,007	0.1
Talos Production, Inc.	12.00%	01/15/2026	11,973	12,350,657	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.	7.75%	10/15/2024	11,446	11,638,471	0.1
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	1,000	965,724	0.0
Transocean, Inc.	7.25%	11/01/2025	72	57,154	0.0
Transocean, Inc.	7.50%	01/15/2026	27,681	21,653,090	0.1
Transocean, Inc.	8.00%	02/01/2027	4,000	2,978,815	0.0
Transocean, Inc.	11.50%	01/30/2027	5,345	5,373,191	0.0
Venture Global Calcasieu Pass LLC	4.13%	08/15/2031	4,979	5,221,225	0.0
W&T Offshore, Inc.	9.75%	11/01/2023	23,933	22,405,329	0.1
Weatherford International Ltd.	11.00%	12/01/2024	968	1,011,092	0.0
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	4,301	4,519,053	0.0
Western Midstream Operating LP	4.00%	07/01/2022	5,337	5,404,847	0.0
Western Midstream Operating LP	4.35%	02/01/2025	11,908	12,509,989	0.1
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	13,423	14,450,334	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	3,831	4,201,919	0.0
Western Midstream Operating LP	5.45%	04/01/2044	5,469	6,213,791	0.0
				<u>1,147,025,694</u>	<u>5.5</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Interface, Inc.	5.50%	12/01/2028	4,882	5,120,053	0.0
KAR Auction Services, Inc.	5.13%	06/01/2025	1,160	1,186,327	0.0
				<u>6,306,380</u>	<u>0.0</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.00%	06/01/2029	13,593	13,592,205	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	22,051	23,561,419	0.1
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	9.75%	07/15/2027	35,694	39,051,232	0.2
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./ Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 8,760	11,936,898	0.1
APCOA Parking Holdings GmbH	4.63%	01/15/2027	EUR 1,541	1,849,983	0.0
Aptim Corp.	7.75%	06/15/2025	USD 34,041	28,610,923	0.1
APX Group, Inc.	5.75%	07/15/2029	46,964	47,100,562	0.2
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	8,465	9,068,859	0.0
APX Group, Inc.	7.63%	09/01/2023	12,275	12,508,961	0.1
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025	20,566	21,748,574	0.1
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	16,622	17,714,170	0.1
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023	EUR 4,540	5,318,659	0.0
Garda World Security Corp.	4.63%	02/15/2027	USD 2,000	2,005,007	0.0
Garda World Security Corp.	6.00%	06/01/2029	15,311	14,799,063	0.1
Garda World Security Corp.	9.50%	11/01/2027	43,763	47,632,864	0.2
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028	8,833	9,115,744	0.0
Korn Ferry	4.63%	12/15/2027	17,280	17,892,014	0.1
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	30,817	31,624,269	0.2
MoneyGram International, Inc.	5.38%	08/01/2026	7,932	8,089,242	0.0
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	23,935	24,319,136	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	58,475	55,846,431	0.3
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.63%	10/01/2028	10,955	11,533,373	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.88%	10/01/2030	USD 11,761	\$ 12,569,091	0.1%
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	3,000	3,247,738	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	6.25%	01/15/2028	50,428	52,253,858	0.2
Sabre GBLB, Inc.	7.38%	09/01/2025	17,465	18,517,345	0.1
Sabre GBLB, Inc.	9.25%	04/15/2025	12,443	14,341,392	0.1
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	15,163	16,037,619	0.1
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	EUR 21,242	25,833,936	0.1
Verscend Escrow Corp.	9.75%	08/15/2026	USD 57,645	60,965,070	0.3
				<u>658,685,637</u>	<u>3.2</u>
TECHNOLOGIE					
Ahead DB Holdings LLC	6.63%	05/01/2028	17,297	17,653,733	0.1
Austin BidCo, Inc.	7.13%	12/15/2028	17,654	17,908,696	0.1
Avaya, Inc.	6.13%	09/15/2028	44,942	47,426,662	0.2
Banff Merger Sub, Inc.	9.75%	09/01/2026	60,004	62,843,536	0.3
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	14,476	15,492,051	0.1
Cablevision Lightpath LLC	5.63%	09/15/2028	16,278	16,374,444	0.1
Clarivate Science Holdings Corp.	4.88%	07/01/2029	9,245	9,532,088	0.0
CommScope, Inc.	4.75%	09/01/2029	5,241	5,300,849	0.0
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	15,921	16,688,731	0.1
CommScope, Inc.	8.25%	03/01/2027	8,825	9,297,282	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	9,315	10,882,466	0.1
Dell International LLC/EMC Corp.	7.13%	06/15/2024	7,936	8,114,560	0.0
LogMeIn, Inc.	5.50%	09/01/2027	13,368	13,897,223	0.1
NCR Corp.	5.00%	10/01/2028	3,000	3,106,283	0.0
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	11,568	12,268,759	0.1
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	11,508	12,527,638	0.1
Presidio Holdings, Inc.	4.88%	02/01/2027	10,848	11,254,114	0.1
Presidio Holdings, Inc.	8.25%	02/01/2028	35,003	37,912,350	0.1
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	2,038	2,127,453	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	25,862	27,381,693	0.1
Seagate HDD Cayman	4.88%	06/01/2027	11,014	12,369,789	0.1
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	71,083	73,871,821	0.3
				<u>444,232,221</u>	<u>2.1</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Air Canada	3.88%	08/15/2026	8,507	8,553,772	0.1
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	23,831	25,068,147	0.1
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	20,260	21,796,655	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./ HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	13,097	13,791,111	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	20,443	23,232,907	0.1
United Airlines, Inc.	4.63%	04/15/2029	7,072	7,337,895	0.0
				<u>99,780,487</u>	<u>0.5</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
AerCap Global Aviation Trust	6.50%	06/15/2045	2,000	2,170,334	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.25%	03/15/2025	2,868	2,918,190	0.0
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	15,633	16,410,629	0.1
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.75%	07/15/2027	32,463	33,874,309	0.2
Herc Holdings, Inc.	5.50%	07/15/2027	17,323	18,256,552	0.1
Modulaire Global Finance PLC.	8.00%	02/15/2023	39,923	40,990,938	0.2
United Rentals North America, Inc.	4.00%	07/15/2030	2,000	2,091,072	0.0
				<u>116,712,024</u>	<u>0.6</u>
				<u>7,486,774,159</u>	<u>36.0</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Alliance Data Systems Corp.	4.75%	12/15/2024	24,532	25,141,165	0.1
Alliance Data Systems Corp.	7.00%	01/15/2026	11,510	12,344,475	0.1
Ally Financial, Inc., Series C(d)	4.70%	05/15/2028	16,427	17,104,614	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(d)	5.88%	05/24/2022	EUR 16,000	19,526,607	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(d).	6.50%	03/05/2025	USD 41,600	45,475,643	0.2
Banco Santander SA(d)	6.75%	04/25/2022	EUR 39,400	48,154,983	0.2
Bank of Ireland, Series E	10.00%	12/19/2022	15,000	19,953,350	0.1
CaixaBank SA(d)	5.88%	10/09/2027	200	275,410	0.0
Citizens Financial Group, Inc., Series B(d)	6.00%	07/06/2023	USD 8,895	9,294,046	0.0
Credit Suisse Group AG(d)	6.25%	12/18/2024	31,464	34,205,539	0.2
Credit Suisse Group AG(d)	7.50%	07/17/2023	35,155	37,905,246	0.2
Credit Suisse Group AG(d)	7.50%	12/11/2023	10,650	11,742,817	0.1
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	5,173	7,494,601	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	206	223,422	0.0
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	11,463	12,891,837	0.1
Societe Generale SA(d)	8.00%	09/29/2025	44,504	52,615,710	0.2
UniCredit SpA(d)	9.25%	06/03/2022	EUR 21,339	26,743,911	0.1
				<u>381,093,376</u>	<u>1.8</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
MAKLER						
	NFP Corp.	6.88%	08/15/2028	USD 56,445	\$ 57,948,341	0.3%
FINANZEN						
	Aircastle Ltd.(d)	5.25%	06/15/2026	15,039	15,121,027	0.1
	CNG Holdings, Inc.	12.50%	06/15/2024	17,033	16,254,070	0.1
	Compass Group Diversified Holdings LLC	5.25%	04/15/2029	17,385	18,218,159	0.1
	Curo Group Holdings Corp.	7.50%	08/01/2028	38,536	38,434,239	0.2
	Enova International, Inc.	8.50%	09/01/2024	6,350	6,474,134	0.0
	Enova International, Inc.	8.50%	09/15/2025	32,666	33,868,562	0.2
	goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024	14,674	15,142,765	0.1
	HighTower Holding, LLC	6.75%	04/15/2029	29,639	30,450,534	0.2
	ILFC E-Capital Trust I(e)	3.66%	12/21/2065	9,500	7,752,398	0.0
	Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	28,217	28,918,422	0.1
	Navient Corp.	5.00%	03/15/2027	2,000	2,095,695	0.0
	Navient Corp.	5.88%	10/25/2024	1,000	1,088,925	0.0
	Navient Corp.	6.50%	06/15/2022	6,777	7,051,840	0.0
	Navient Corp.	7.25%	09/25/2023	304	334,110	0.0
	OneMain Finance Corp.	6.88%	03/15/2025	6,000	6,801,742	0.0
	SLM Corp.	5.13%	04/05/2022	10,162	10,336,915	0.1
	Springleaf Finance Corp.	7.13%	03/15/2026	3,000	3,504,377	0.0
					<u>241,847,914</u>	<u>1.2</u>
VERSICHERUNGEN						
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	6.00%	08/01/2029	2,239	2,202,185	0.0
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	7.00%	11/15/2025	44,139	44,976,678	0.2
	Acrisure LLC/Acrisure Finance, Inc.	10.13%	08/01/2026	21,929	24,692,961	0.1
	Alliant Holdings Intermediate LLC/Alliant Holdings Co-Issuer. . .	6.75%	10/15/2027	56,684	59,043,741	0.3
	AmWINS Group, Inc.	4.88%	06/30/2029	8,871	9,022,483	0.1
	Ardonagh Midco 2 PLC(a)	11.50%	01/15/2027	34,727	37,442,950	0.2
	AssuredPartners, Inc.	5.63%	01/15/2029	37,614	37,849,199	0.2
	HUB International Ltd.	7.00%	05/01/2026	6,220	6,440,575	0.0
	USI, Inc./NY	6.88%	05/01/2025	2,000	2,040,949	0.0
					<u>223,711,721</u>	<u>1.1</u>
SONSTIGE FINANZWERTE						
	Altice France Holding SA	10.50%	05/15/2027	16,348	17,972,796	0.1
	Intrum AB	3.50%	07/15/2026	EUR 16,915	20,330,540	0.1
	Intrum AB	4.88%	08/15/2025	10,509	13,040,380	0.0
					<u>51,343,716</u>	<u>0.2</u>
REITs						
	Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	USD 35,255	36,438,424	0.2
	Diversified Healthcare Trust	4.75%	02/15/2028	3,000	3,049,875	0.0
	Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	23,996	26,477,607	0.1
	Iron Mountain UK PLC	3.88%	11/15/2025	GBP 1,000	1,392,573	0.0
	Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2027	USD 1,028	1,073,099	0.0
	Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	13,788	14,546,293	0.1
	Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,641	11,142,034	0.1
	Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	2,653	2,793,966	0.0
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	4.63%	06/15/2025	4,985	5,366,919	0.0
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.63%	05/01/2024	3,667	4,002,927	0.0
	MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.75%	02/01/2027	2,493	2,871,488	0.0
	Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	9,031	9,299,227	0.0
	Realogy Group LLC/Realogy Co-Issuer Corp.	9.38%	04/01/2027	48,969	54,134,940	0.3
	VICI Properties LP/VICI Note Co., Inc.	4.13%	08/15/2030	3,000	3,202,884	0.0
					<u>175,792,256</u>	<u>0.8</u>
					<u>1,131,737,324</u>	<u>5.4</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE						
ELEKTRIZITÄT						
	Calpine Corp.	4.50%	02/15/2028	1,000	1,030,327	0.0
	Calpine Corp.	4.63%	02/01/2029	1,000	1,003,902	0.0
	Calpine Corp.	5.00%	02/01/2031	4,000	4,083,379	0.0
	Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028	17,753	18,106,562	0.1
	Calpine Corp.	5.25%	06/01/2026	1,341	1,380,571	0.0
	NRG Energy, Inc.	6.63%	01/15/2027	784	812,918	0.0
	Talen Energy Supply LLC	6.50%	06/01/2025	26,817	11,674,991	0.1
	Talen Energy Supply LLC	7.25%	05/15/2027	6,399	5,535,152	0.0
	Talen Energy Supply LLC	10.50%	01/15/2026	45,563	21,170,233	0.1
					<u>64,798,035</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE VERSORGENSBETRIEBE					
Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	USD 7,480	\$ 7,930,479	0.1%
				<u>72,728,514</u>	<u>0.4</u>
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
ENERGIE					
Citgo Holding, Inc.	9.25%	08/01/2024	31,077	<u>31,113,857</u>	<u>0.2</u>
WANDELANLEIHEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
DISH Network Corp.(b).....	3.38%	08/15/2026	6,494	<u>6,792,435</u>	<u>0.0</u>
				<u>8,729,146,289</u>	<u>42.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond	8.00%	11/26/2029	61,420	64,540,904	0.3
Angolan Government International Bond	8.25%	05/09/2028	28,770	30,564,529	0.1
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	56,178	58,505,876	0.3
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	10,509	<u>11,125,090</u>	<u>0.1</u>
				<u>164,736,399</u>	<u>0.8</u>
ARGENTINIEN					
Argentine Republic Government International Bond	0.50%	07/09/2030	108,293	42,125,971	0.2
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	20,068	8,137,379	0.0
Argentine Republic Government International Bond	1.13%	07/09/2035	285,291	99,138,726	0.5
Argentine Republic Government International Bond	2.00%	01/09/2038	24,411	9,971,809	0.0
Argentine Republic Government International Bond	2.50%	07/09/2041	30,585	<u>11,928,115</u>	<u>0.1</u>
				<u>171,302,000</u>	<u>0.8</u>
KOLUMBIEN					
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	17,589	19,593,047	0.1
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	9,337	10,888,109	0.0
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	13,795	<u>17,824,002</u>	<u>0.1</u>
				<u>48,305,158</u>	<u>0.2</u>
COSTA RICA					
Costa Rica Government International Bond	6.13%	02/19/2031	32,771	<u>34,774,127</u>	<u>0.2</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	5.50%	01/27/2025	3,775	4,128,434	0.0
Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060	14,092	14,363,271	0.1
Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	27,913	31,646,364	0.2
Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	63,400	72,593,000	0.3
Dominican Republic International Bond	6.40%	06/05/2049	6,674	7,296,768	0.0
Dominican Republic International Bond	6.50%	02/15/2048	7,709	8,522,299	0.0
Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026	9,441	10,988,734	0.1
Dominican Republic International Bond	7.45%	04/30/2044	17,877	21,913,850	0.1
Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	16,359	<u>19,981,496</u>	<u>0.1</u>
				<u>191,434,216</u>	<u>0.9</u>
ECUADOR					
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	5,863	3,305,057	0.0
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	16,709	10,672,581	0.1
Ecuador Government International Bond	1.00%	07/31/2035	92,884	66,876,358	0.3
Ecuador Government International Bond	5.00%	07/31/2030	27,255	<u>24,358,936</u>	<u>0.1</u>
				<u>105,212,932</u>	<u>0.5</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government International Bond	3.88%	02/16/2026	5,392	5,284,160	0.0
Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031	3,822	3,755,115	0.0
Egypt Government International Bond	6.20%	03/01/2024	28,900	31,009,700	0.2
Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	7,360	7,759,280	0.0
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	15,058	16,688,970	0.1
Egypt Government International Bond	7.60%	03/01/2029	16,788	18,370,269	0.1
Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	43,364	46,204,342	0.2
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	7,580	7,941,471	0.0
Egypt Government International Bond	8.70%	03/01/2049	10,320	10,860,510	0.1
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	22,855	<u>24,501,988</u>	<u>0.1</u>
				<u>172,375,805</u>	<u>0.8</u>
EL SALVADOR					
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	19,017	16,782,502	0.1
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	8,560	7,404,400	0.0
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	41,430	33,817,238	0.2
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	1,843	<u>1,596,499</u>	<u>0.0</u>
				<u>59,600,639</u>	<u>0.3</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
GABUN					
Gabon Government International Bond	6.38%	12/12/2024	USD 10,308	\$ 11,060,007	0.1%
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	28,288	28,699,944	0.1
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	17,720	19,550,697	0.1
				<u>59,310,648</u>	<u>0.3</u>
GHANA					
Ghana Government International Bond	7.63%	05/16/2029	17,955	17,941,534	0.1
Ghana Government International Bond	7.75%	04/07/2029	16,009	16,109,056	0.1
Ghana Government International Bond	8.13%	01/18/2026	10,000	10,351,875	0.0
Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	31,733	31,729,033	0.1
Ghana Government International Bond	8.63%	04/07/2034	11,455	11,569,550	0.1
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	25,866	24,723,046	0.1
Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051	6,050	5,928,244	0.0
Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030	11,717	14,641,124	0.1
				<u>132,993,462</u>	<u>0.6</u>
HONDURAS					
Honduras Government International Bond	5.63%	06/24/2030	4,772	5,060,706	0.0
Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	36,976	40,865,413	0.2
Honduras Government International Bond	7.50%	03/15/2024	13,637	14,589,885	0.1
				<u>60,516,004</u>	<u>0.3</u>
IRAK					
Iraq International Bond	5.80%	01/15/2028	22,081	21,209,101	0.1
ELFENBEINKÜSTE					
Ivory Coast Government International Bond	4.88%	01/30/2032	EUR 43,563	52,443,248	0.3
Ivory Coast Government International Bond	5.13%	06/15/2025	3,272	4,313,260	0.0
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	USD 6,219	6,814,858	0.0
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	44,268	49,284,118	0.2
Ivory Coast Government International Bond	6.88%	10/17/2040	EUR 39,053	51,524,205	0.3
				<u>164,379,689</u>	<u>0.8</u>
JAMAICA					
Jamaica Government International Bond	6.75%	04/28/2028	USD 4,743	5,549,310	0.0
KENIA					
Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	16,016	17,595,578	0.1
Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	9,643	10,820,049	0.1
Republic of Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024	30,874	33,928,596	0.1
				<u>62,344,223</u>	<u>0.3</u>
LIBANON					
Lebanon Government International Bond(c)	6.65%	04/22/2024	4,315	539,375	0.0
Lebanon Government International Bond(c)	6.85%	03/23/2027	5,606	700,750	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(c)	6.60%	11/27/2026	10,759	1,344,875	0.0
				<u>2,585,000</u>	<u>0.0</u>
MEXIKO					
Mexico Government International Bond	4.75%	04/27/2032	10,750	12,435,062	0.1
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	5.63%	06/27/2022	4,260	4,393,924	0.0
Nigeria Government International Bond	6.38%	07/12/2023	8,691	9,252,113	0.0
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	4,404	4,637,412	0.0
Nigeria Government International Bond	7.14%	02/23/2030	39,437	41,391,596	0.2
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/21/2025	31,750	35,496,500	0.2
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	15,679	15,745,636	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	14,105	14,420,599	0.1
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	29,112	31,264,468	0.2
				<u>156,602,248</u>	<u>0.8</u>
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	6.00%	04/08/2026	15,032	15,108,814	0.1
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	918	938,827	0.0
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	18,046	18,273,560	0.1
				<u>34,321,201</u>	<u>0.2</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	4.30%	10/12/2028	21,899	22,607,980	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	8,663	8,699,818	0.0
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	117,613	118,333,380	0.6
Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	06/22/2030	17,500	19,876,719	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	1,684	1,817,983	0.0
				<u>171,335,880</u>	<u>0.8</u>
SRI LANKA					
Sri Lanka Government International Bond	6.20%	05/11/2027	12,953	8,353,066	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2033	USD 22,766	\$ 24,122,000	0.1%
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	24,077	25,729,284	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2023	60,102	64,759,905	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2024	38,721	42,455,157	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	10,000	11,040,000	0.1
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2027	13,037	14,518,329	0.1
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2028	9,111	11,037,407	0.1
				<u>193,662,082</u>	<u>0.9</u>
VENEZUELA					
Venezuela Government International Bond(c)	9.00%	05/07/2023	4,270	427,000	0.0
Venezuela Government International Bond(c)	9.25%	09/15/2027	57,269	5,726,900	0.0
				<u>6,153,900</u>	<u>0.0</u>
				<u>2,039,492,152</u>	<u>9.8</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	24,763	26,063,057	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	10,931	11,848,809	0.1
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	32,575	34,838,148	0.2
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	10,002	9,859,471	0.0
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	5,245	5,766,222	0.0
CSN Resources SA	7.63%	04/17/2026	33,346	35,525,995	0.2
Eldorado Gold Corp.	6.25%	09/01/2029	20,939	21,272,997	0.1
Eldorado Gold Corp.	9.50%	06/01/2024	19,494	21,278,828	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	6.88%	10/15/2027	33,725	36,460,288	0.2
First Quantum Minerals Ltd.	7.25%	04/01/2023	21,596	21,960,432	0.1
First Quantum Minerals Ltd.	7.50%	04/01/2025	10,621	11,042,521	0.1
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	14,504	15,340,699	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	35,078	36,862,769	0.2
JSW Steel Ltd.	5.95%	04/18/2024	9,640	10,313,595	0.1
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	24,137	26,692,163	0.1
OCP SA	3.75%	06/23/2031	7,803	7,890,784	0.0
Sasol Financing USA LLC	5.88%	03/27/2024	9,655	10,272,317	0.0
Stillwater Mining Co.	7.13%	06/27/2025	20,000	20,761,455	0.1
Suzano Austria GmbH	7.00%	03/16/2047	4,960	6,693,830	0.0
Vale Overseas Ltd.	3.75%	07/08/2030	3,970	4,230,567	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC	13.88%	01/21/2024	40,014	44,033,295	0.2
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	4,778	4,632,151	0.0
				<u>423,640,393</u>	<u>2.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV(d)	5.13%	09/08/2169	17,508	18,278,352	0.1
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	10,634	11,984,518	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,390	28,253,794	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	23,369	26,594,388	0.1
Klabin Austria GmbH	7.00%	04/03/2049	6,722	8,503,849	0.0
				<u>93,614,901</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	6,730	6,888,996	0.1
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028	4,248	4,512,665	0.0
				<u>11,401,661</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	25,208	26,740,177	0.1
C&W Senior Financing DAC	7.50%	10/15/2026	14,419	15,007,513	0.1
Digicel International Finance Ltd./ Digicel international Holdings Ltd.	8.75%	05/25/2024	4,359	4,526,549	0.0
MTN Mauritius Investments Ltd.	6.50%	10/13/2026	3,770	4,349,638	0.0
Oi Movel SA	8.75%	07/30/2026	16,489	17,062,817	0.1
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	15,802	16,596,788	0.1
				<u>84,283,482</u>	<u>0.4</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF GmbH	4.35%	09/29/2026	6,109	6,403,633	0.1
BRF SA	5.75%	09/21/2050	5,556	5,621,283	0.0
Cosan Ltd.	5.50%	09/20/2029	13,818	14,826,714	0.1
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	5,581	6,007,598	0.0
				<u>32,859,228</u>	<u>0.2</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	USD 23,645	\$ 28,469,053	0.1%
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	5,142	5,158,386	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	9,261	8,059,978	0.0
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	3,062	3,195,580	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	1,813	1,848,467	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	8,915	9,751,609	0.1
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	13,719	13,058,033	0.1
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	15,289	15,951,205	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	11,379	12,390,934	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	3,463	3,578,361	0.0
Peru LNG SRL	5.38%	03/22/2030	23,584	18,705,060	0.1
Petrobras Global Finance BV	5.60%	01/03/2031	56,775	63,799,565	0.3
Petrobras Global Finance BV	7.38%	01/17/2027	25,478	31,181,873	0.2
Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026	12,234	15,700,045	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	7,683	8,720,995	0.0
SEPLAT Energy PLC	7.75%	04/01/2026	17,384	18,035,900	0.1
SierraCol Energy Andina LLC	6.00%	06/15/2028	4,987	4,973,946	0.0
				<u>262,578,990</u>	<u>1.3</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Stoneco Ltd.	3.95%	06/16/2028	5,172	5,058,914	0.0
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	304	328,909	0.0
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Aeropuertos Dominicanos Siglo XXI SA	6.75%	03/30/2029	10,660	11,086,400	0.1
				<u>924,852,878</u>	<u>4.5</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(d)	6.38%	05/27/2026	6,561	6,856,245	0.0
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple Grupo Financiero Santand	5.38%	04/17/2025	16,733	18,921,676	0.1
BBVA Bancomer SA/Texas	5.88%	09/13/2034	3,720	4,082,495	0.0
Fidelity Bank PLC	10.50%	10/16/2022	11,480	12,285,753	0.1
				<u>42,146,169</u>	<u>0.2</u>
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	3.75%	04/27/2022	750	736,875	0.0
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	4,249	4,206,510	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.25%	11/13/2024	2,492	2,386,090	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.75%	05/29/2024	1,330	1,296,750	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	4.50%	05/29/2029	6,073	5,875,627	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026	5,895	5,836,050	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.88%	11/22/2026	2,841	2,833,898	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	20,581	20,992,620	0.1
				<u>44,164,420</u>	<u>0.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(a)	4.38%	10/25/2029	3,065	308,053	0.0
OEC Finance Ltd.(a)	5.25%	12/27/2033	3,475	314,477	0.0
OEC Finance Ltd.(a)	7.13%	12/26/2046	32,513	3,005,896	0.0
				<u>3,628,426</u>	<u>0.0</u>
REITs					
Central China Real Estate Ltd.	7.50%	07/14/2025	1,313	998,265	0.0
Central China Real Estate Ltd.	7.75%	05/24/2024	203	156,949	0.0
China Aoyuan Group Ltd.	5.38%	09/13/2022	206	200,393	0.0
China Aoyuan Group Ltd.	5.88%	03/01/2027	202	168,114	0.0
Ronshine China Holdings Ltd.	7.10%	01/25/2025	208	179,049	0.0
Scenery Journey Ltd.	11.50%	10/24/2022	9,136	3,152,834	0.0
Scenery Journey Ltd.	12.00%	10/24/2023	3,890	1,322,600	0.0
Trust Fibra Uno	4.87%	01/15/2030	27,786	30,535,077	0.2
Trust Fibra Uno	6.39%	01/15/2050	726	874,685	0.0
Trust Fibra Uno	6.95%	01/30/2044	3,173	3,975,769	0.0
Yango Justice International Ltd.	7.50%	02/17/2025	1,211	1,035,405	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.	6.35%	01/13/2027	245	185,248	0.0
				<u>42,784,388</u>	<u>0.2</u>
				<u>132,723,403</u>	<u>0.6</u>
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	53,439	57,523,744	0.3
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	30,851	32,052,261	0.1
				<u>89,576,005</u>	<u>0.4</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
AES Andes SA	6.35%	10/07/2019	USD 10,186	\$ 10,644,370	0.1%
AES El Salvador Trust II	6.75%	03/28/2023	5,470	5,269,319	0.0
Cemig Geracao e Transmissao SA	9.25%	12/05/2024	31,570	36,195,005	0.1
Light Servicos De Eletricidade	4.38%	06/18/2026	13,720	13,943,122	0.1
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.	6.75%	04/24/2033	12,857	14,755,990	0.1
				<u>80,807,806</u>	<u>0.4</u>
QUASI-STAAITSANLEIHEN					
BRASILIEN					
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	7,373	8,153,756	0.0
				<u>3,275,606,000</u>	<u>15.7</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	29,736	42,816,440	0.3
Bank of America Corp., Series AA(d)	6.10%	03/17/2025	14,150	15,859,745	0.1
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	32,004	41,110,166	0.2
Bank of America Corp., Series DD(d)	6.30%	03/10/2026	29,824	34,719,052	0.2
Bank of America Corp., Series X(d)	6.25%	09/05/2024	7,260	8,041,770	0.0
Bank of America Corp., Series Z(d)	6.50%	10/23/2024	808	911,910	0.0
Barclays Bank PLC(d)	6.86%	06/15/2032	1,667	2,263,318	0.0
Barclays PLC(d)	7.13%	06/15/2025	GBP 13,922	21,745,709	0.1
Barclays PLC(d)	7.25%	03/15/2023	5,167	7,592,701	0.0
BNP Paribas SA(d)	6.75%	03/14/2022	USD 15,725	16,141,219	0.1
CIT Group, Inc.	3.93%	06/19/2024	6,749	7,097,976	0.0
Citigroup, Inc.(d)	3.88%	02/18/2026	8,826	9,079,748	0.1
Citigroup, Inc.(d)	5.95%	01/30/2023	33,515	35,206,038	0.2
Citigroup, Inc., Series T(d)	6.25%	08/15/2026	5,672	6,612,779	0.0
Citigroup, Inc., Series V(d)	4.70%	01/30/2025	8,408	8,775,599	0.0
Citigroup, Inc., Series W(d)	4.00%	12/10/2025	7,221	7,504,884	0.0
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	1,629	1,840,489	0.0
Credit Agricole SA(d)	8.13%	12/23/2025	35,763	43,547,455	0.2
Credit Suisse AG	6.50%	08/08/2023	9,231	10,150,288	0.1
DNB Bank ASA(d)	6.50%	03/26/2022	48,000	49,429,426	0.2
Erste Group Bank AG(d)	6.50%	04/15/2024	EUR 10,600	13,972,470	0.1
Erste Group Bank AG(d)	8.88%	10/15/2021	12,800	15,265,192	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(d)	5.30%	11/10/2026	USD 3,702	4,117,958	0.0
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(d)	5.00%	11/10/2022	32,640	32,990,158	0.2
HSBC Holdings PLC(d)	6.00%	09/29/2023	EUR 6,504	8,380,115	0.0
HSBC Holdings PLC(d)	6.38%	03/30/2025	USD 5,220	5,774,625	0.0
HSBC Holdings PLC, Series E(d)	4.75%	07/04/2029	EUR 9,250	12,410,051	0.1
ING Groep NV(d)	6.50%	04/16/2025	USD 24,907	27,715,839	0.1
ING Groep NV(d)	6.75%	04/16/2024	5,795	6,347,196	0.0
JPMorgan Chase & Co., Series R(d)	6.00%	08/01/2023	15,000	15,936,736	0.1
Lloyds Banking Group PLC(d)	6.41%	10/01/2035	1,976	2,750,836	0.0
Lloyds Banking Group PLC(d)	6.66%	05/21/2037	1,067	1,518,750	0.0
Lloyds Banking Group PLC(d)	7.50%	06/27/2024	6,268	7,021,358	0.0
Natwest Group PLC, Series U(d) (f)	2.47%	09/30/2027	15,100	15,045,290	0.1
Regions Bank/Birmingham AL	6.45%	06/26/2037	28,048	40,267,367	0.2
Skandinaviska Enskilda Banken AB(d)	5.63%	05/13/2022	4,000	4,110,442	0.0
Standard Chartered PLC(d) (f)	1.64%	01/30/2027	16,000	15,524,220	0.1
Standard Chartered PLC(d)	7.75%	04/02/2023	13,945	15,149,997	0.1
Swedbank AB(d)	6.00%	03/17/2022	5,800	5,938,848	0.0
UBS AG/Stamford CT	7.63%	08/17/2022	3,729	3,972,148	0.0
UBS Group AG(d)	7.00%	01/31/2024	49,607	54,505,691	0.3
UBS Group AG(d)	7.00%	02/19/2025	32,133	36,911,024	0.2
				<u>716,073,029</u>	<u>3.5</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(d)	5.38%	06/01/2025	26,176	29,150,009	0.1
FINANZEN					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028	6,059	6,499,366	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025	3,386	3,955,301	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	5,211	5,330,496	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	648	712,594	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	42,255	47,419,736	0.2
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	1,558	1,566,969	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	5,788	6,136,841	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	7,715	8,359,799	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	12,125	12,996,025	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	5,387	5,992,754	0.0
				<u>98,969,881</u>	<u>0.5</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VERSICHERUNGEN					
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	USD 39,949	\$ 53,630,192	0.3%
American International Group, Inc.	6.82%	11/15/2037	15,085	21,484,082	0.1
Aon Corp.	8.21%	01/01/2027	13,915	18,196,113	0.1
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(f)	2.25%	02/12/2047	10,000	9,613,328	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	EUR 1,111	1,369,413	0.0
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	USD 36,487	48,982,605	0.2
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	7,000	9,761,900	0.1
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	16,185	28,715,416	0.1
Nationwide Financial Services, Inc.	6.75%	05/15/2037	3,000	3,696,897	0.0
Nationwide Mutual Insurance Co.	9.38%	08/15/2039	22,662	40,344,593	0.2
Transatlantic Holdings, Inc.	8.00%	11/30/2039	14,148	22,192,466	0.1
				<u>257,987,005</u>	<u>1.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	1,974	2,164,893	0.0
REITs					
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	3,685	3,943,300	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.00%	10/15/2027	2,644	2,803,030	0.0
				<u>6,746,330</u>	<u>0.0</u>
				<u>1,111,091,147</u>	<u>5.3</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
ArcelorMittal SA	6.75%	03/01/2041	14,928	21,204,562	0.1
ArcelorMittal SA	7.00%	10/15/2039	11,517	16,525,145	0.1
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	20,000	21,152,073	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	20,942	25,830,333	0.1
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,106	18,334,199	0.1
Glencore Finance Canada Ltd.	6.00%	11/15/2041	4,277	5,786,435	0.1
MEGlobal Canada ULC.	5.88%	05/18/2030	2,186	2,724,356	0.0
Smurfit Kappa Treasury Funding DAC	7.50%	11/20/2025	4,264	5,308,617	0.0
				<u>116,865,720</u>	<u>0.6</u>
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co., Series D(d) (f)	3.45%	12/15/2021	30,828	29,952,143	0.1
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Qwest Corp.	6.75%	12/01/2021	15,325	15,539,939	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	2,398	3,281,632	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	3,641	4,586,236	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.00%	10/06/2026	1,162	1,285,103	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.65%	01/17/2029	11,876	14,457,212	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	12,304	13,341,490	0.1
				<u>36,951,673</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Marriott International, Inc./MD, Series EE	5.75%	05/01/2025	6,031	6,929,138	0.0
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	31,126	40,130,541	0.2
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	2,898	4,238,147	0.0
PulteGroup, Inc.	6.00%	02/15/2035	615	812,566	0.0
PulteGroup, Inc.	6.38%	05/15/2033	10,924	14,614,079	0.1
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	27,955	40,795,043	0.2
				<u>107,519,514</u>	<u>0.5</u>
ENERGIE					
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	5,144	6,954,322	0.0
Continental Resources, Inc./OK	5.75%	01/15/2031	19,163	23,357,970	0.1
Energy Transfer LP	6.25%	04/15/2049	1,000	1,324,774	0.0
Energy Transfer LP	8.25%	11/15/2029	8,521	11,729,750	0.1
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	2,953	4,015,254	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.75%	01/15/2032	4,518	6,538,053	0.0
Kinder Morgan, Inc., Series G	7.80%	08/01/2031	18,933	27,268,873	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	6,690	7,508,321	0.1
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.65%	10/15/2025	20,509	22,849,732	0.1
				<u>111,547,049</u>	<u>0.5</u>
TECHNOLOGIE					
Dell International LLC/EMC Corp.	8.35%	07/15/2046	9,330	15,391,277	0.1
Nokia Oyj.	6.63%	05/15/2039	2,000	2,782,317	0.0
				<u>18,173,594</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	USD 27,353	\$ 32,005,943	0.1%
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	17,879	19,868,039	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/ Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	48,950	53,242,218	0.3
				<u>105,116,200</u>	<u>0.5</u>
				<u>541,665,832</u>	<u>2.6</u>
				<u>1,652,756,979</u>	<u>7.9</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds(g)	1.38%	08/15/2050	179,875	157,250,107	0.8
U.S. Treasury Bonds(g)	6.00%	02/15/2026	293,266	361,542,484	1.7
U.S. Treasury Bonds(g)	6.13%	11/15/2027	62,738	82,304,807	0.4
U.S. Treasury Bonds(g)	6.25%	05/15/2030	83,300	118,233,938	0.6
U.S. Treasury Bonds(g)	6.63%	02/15/2027	55,285	72,302,283	0.4
U.S. Treasury Bonds(g)	6.75%	08/15/2026	212,755	274,487,182	1.3
U.S. Treasury Bonds(g)	7.50%	11/15/2024	58,500	71,680,781	0.3
U.S. Treasury Bonds(g)	7.63%	02/15/2025	41,846	52,059,039	0.3
U.S. Treasury Notes(g)	0.38%	04/30/2025	5,100	5,066,531	0.0
U.S. Treasury Notes	0.63%	08/15/2030	200	189,500	0.0
U.S. Treasury Notes(g)	1.13%	02/15/2031	114,128	112,630,070	0.5
U.S. Treasury Notes	1.25%	08/15/2031	108,798	108,270,706	0.5
				<u>1,416,017,428</u>	<u>6.8</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-1A, Class B1(f)	4.33%	04/25/2028	3,894	3,912,949	0.0
Series 2018-3A, Class M2(f)	2.83%	10/25/2028	14,474	14,510,303	0.1
Series 2019-4A, Class M2(f)	2.93%	10/25/2029	9,310	9,420,572	0.1
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1B1(f)	4.43%	04/25/2031	8,645	8,956,364	0.0
Series 2020-SBT1, Class 1M2(f)	3.73%	02/25/2040	29,195	30,179,857	0.1
Series 2020-SBT1, Class 2M2(f)	3.73%	02/25/2040	17,621	18,243,115	0.1
Eagle Re Ltd					
Series 2019-1, Class M1B(f)	1.88%	04/25/2029	894	893,771	0.0
Series 2019-1, Class M2(f)	3.38%	04/25/2029	3,654	3,690,015	0.0
Series 2020-1, Class M2(f)	2.08%	01/25/2030	10,952	10,746,970	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2013-DN2, Class M2(f)	4.33%	11/25/2023	2,432	2,486,982	0.0
Series 2014-DN3, Class M3(f)	4.08%	08/25/2024	1,304	1,329,179	0.0
Series 2015-DN1, Class B(f)	11.58%	01/25/2025	1,604	1,635,842	0.0
Series 2015-DNA1, Class B(f)	9.28%	10/25/2027	32,039	36,483,729	0.2
Series 2015-DNA2, Class B(f)	7.63%	12/25/2027	48,176	52,186,072	0.3
Series 2015-DNA3, Class B(f)	9.43%	04/25/2028	15,270	17,235,538	0.1
Series 2015-HQ1, Class B(f)	10.83%	03/25/2025	8,479	8,452,334	0.0
Series 2015-HQ2, Class B(f)	8.03%	05/25/2025	1,442	1,495,695	0.0
Series 2015-HQA1, Class B(f)	8.88%	03/25/2028	19,299	20,924,349	0.1
Series 2015-HQA2, Class B(f)	10.58%	05/25/2028	10,438	11,725,461	0.1
Series 2016-DNA3, Class B(f)	11.33%	12/25/2028	7,243	8,455,577	0.0
Series 2016-DNA4, Class B(f)	8.68%	03/25/2029	8,703	9,322,792	0.0
Series 2016-HQA1, Class B(f)	12.83%	09/25/2028	16,436	19,951,031	0.1
Series 2016-HQA1, Class M3(f)	6.43%	09/25/2028	11,879	12,443,825	0.1
Series 2016-HQA2, Class B(f)	11.58%	11/25/2028	13,643	15,795,615	0.1
Series 2016-HQA4, Class B(f)	8.83%	04/25/2029	2,291	2,434,644	0.0
Series 2017-DNA1, Class B1(f)	5.03%	07/25/2029	25,819	27,820,992	0.1
Series 2017-DNA2, Class B1(f)	5.23%	10/25/2029	40,822	44,600,308	0.2
Series 2017-DNA3, Class B1(f)	4.53%	03/25/2030	53,193	56,184,097	0.3
Series 2017-HQA1, Class B1(f)	5.08%	08/25/2029	1,584	1,700,714	0.0
Series 2017-HQA2, Class B1(f)	4.83%	12/25/2029	9,130	9,778,395	0.1
Series 2017-HQA3, Class B1(f)	4.53%	04/25/2030	4,415	4,635,666	0.0
Series 2018-DNA2, Class B1(f)	3.78%	12/25/2030	5,829	6,052,859	0.0
Series 2019-DNA1, Class B1(f)	4.73%	01/25/2049	3,365	3,521,625	0.0
Series 2019-FTR2, Class M2(f)	2.23%	11/25/2048	6,650	6,654,719	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2014-C01, Class M2(f)	4.48%	01/25/2024	1,775	1,832,762	0.0
Series 2014-C03, Class 2M2(f)	2.98%	07/25/2024	577	586,202	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(f)	4.98%	11/25/2024	20,476	21,071,547	0.1
Series 2015-C02, Class 1M2(f)	4.08%	05/25/2025	9,989	10,160,857	0.1
Series 2015-C03, Class 1M2(f)	5.08%	07/25/2025	904	925,548	0.0
Series 2015-C03, Class 2M2(f)	5.08%	07/25/2025	573	578,112	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(f)	5.78%	04/25/2028	7,852	8,260,566	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2016-C01, Class 1B(f)	11.83%	08/25/2028	USD 39,224	\$ 44,339,921	0.2%
Series 2016-C01, Class 1M2(f)	6.83%	08/25/2028	19,994	21,142,240	0.1
Series 2016-C02, Class 1B(f)	12.33%	09/25/2028	21,442	24,958,958	0.1
Series 2016-C03, Class 1B(f)	11.83%	10/25/2028	7,786	9,002,397	0.0
Series 2016-C03, Class 2B(f)	12.83%	10/25/2028	18,480	22,420,599	0.1
Series 2016-C03, Class 2M2(f)	5.98%	10/25/2028	30,796	32,317,549	0.2
Series 2016-C04, Class 1B(f)	10.33%	01/25/2029	46,188	52,145,521	0.3
Series 2016-C05, Class 2B(f)	11.24%	01/25/2029	36,019	39,423,345	0.2
Series 2016-C06, Class 1B(f)	9.33%	04/25/2029	21,207	23,337,752	0.1
Series 2016-C07, Class 2B(f)	9.58%	05/25/2029	27,703	30,642,682	0.2
Series 2017-C01, Class 1B1(f)	5.83%	07/25/2029	8,561	9,357,326	0.0
Series 2017-C02, Class 2B1(f)	5.58%	09/25/2029	1,584	1,728,561	0.0
Series 2017-C03, Class 1B1(f)	4.93%	10/25/2029	41,247	44,754,807	0.2
Series 2017-C04, Class 2B1(f)	5.13%	11/25/2029	4,454	4,869,845	0.0
Series 2017-C05, Class 1B1(f)	3.68%	01/25/2030	11,946	12,478,013	0.1
Series 2017-C06, Class 1B1(f)	4.23%	02/25/2030	8,320	8,620,915	0.0
Series 2018-C01, Class 1B1(f)	3.63%	07/25/2030	24,895	25,486,411	0.1
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M2(f)	3.08%	10/25/2028	14,423	14,567,774	0.1
Oaktown Re III Ltd., Series 2019-1A, Class M2(f)	2.63%	07/25/2029	2,222	2,235,380	0.0
Radnor Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M2(f)	2.78%	03/25/2028	2,721	2,746,901	0.0
Series 2019-1, Class M2(f)	3.28%	02/25/2029	2,254	2,276,894	0.0
Series 2019-2, Class M1B(f)	1.83%	06/25/2029	519	519,507	0.0
Series 2020-1, Class M2A(f)	2.08%	01/25/2030	11,179	11,178,820	0.1
Series 2020-1, Class M2B(f)	2.33%	01/25/2030	9,514	9,479,424	0.1
Triangle Re Ltd., Series 2020-1, Class M2(f)	5.68%	10/25/2030	7,900	8,157,012	0.0
				<u>985,466,104</u>	<u>4.7</u>

VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE

Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs

Series 4248, Class SL(f) (h)	5.95%	05/15/2041	19,650	3,341,105	0.0
Series 4954, Class SL(f) (h)	5.97%	02/25/2050	24,771	4,620,708	0.0
Series 4981, Class HS(f) (h)	6.02%	06/25/2050	79,093	14,729,564	0.1
Series 4981, Class JS(f) (h)	6.02%	06/25/2050	127,161	23,685,016	0.1
Series 4701, Class NS(f) (h)	6.05%	08/15/2039	7,395	1,596,366	0.0
Series 4125, Class SA(f) (h)	6.05%	11/15/2042	6,599	1,345,616	0.0
Series 4736, Class LS(f) (h)	6.10%	12/15/2047	27,501	6,132,003	0.1
Series 4736, Class SM(f) (h)	6.10%	12/15/2047	57,203	11,666,605	0.1
Series 4774, Class BS(f) (h)	6.10%	02/15/2048	30,554	5,388,850	0.1

Federal National Mortgage Association REMICs

Series 2012-70, Class HS(f) (h)	5.92%	07/25/2042	4,029	798,166	0.0
Series 2016-64, Class SP(f) (h)	5.92%	09/25/2046	20,540	4,427,491	0.0
Series 2016-89, Class SH(f) (h)	5.92%	12/25/2046	14,657	2,933,575	0.0
Series 2019-38, Class SM(f) (h)	5.97%	07/25/2049	6,247	1,310,936	0.0
Series 2019-65, Class SY(f) (h)	5.97%	11/25/2049	12,349	2,493,490	0.0
Series 2013-15, Class SA(f) (h)	6.07%	03/25/2043	17,848	4,043,078	0.0
Series 2017-97, Class SW(f) (h)	6.12%	12/25/2047	32,879	7,616,218	0.1
Series 2018-43, Class SB(f) (h)	6.12%	06/25/2048	9,315	1,714,648	0.0
Series 2018-36, Class SG(f) (h)	6.12%	06/25/2048	15,324	3,202,203	0.0
Series 2015-26, Class SH(f) (h)	6.37%	05/25/2045	5,695	1,229,278	0.0
Series 2005-91, Class SD(f) (h)	6.62%	10/25/2035	6,350	1,277,246	0.0

Government National Mortgage Association

Series 2015-3, Class DS(f) (h)	5.51%	11/20/2041	21,299	2,043,896	0.0
Series 2020-47, Class SG(f) (h)	5.91%	02/20/2049	13,763	2,459,700	0.0
Series 2009-76, Class SB(f) (h)	6.00%	09/16/2039	6,935	1,285,541	0.0
Series 2017-134, Class MS(f) (h)	6.11%	09/20/2047	7,949	1,838,749	0.0
Series 2017-161, Class CS(f) (h)	6.16%	10/20/2047	16,887	3,244,614	0.0
				<u>114,424,662</u>	<u>0.6</u>

FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE

Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs

Series 4398, Class IO(i)	6.00%	10/15/2037	27,299	5,782,271	0.1
Series 4976, Class MI(i)	4.50%	05/25/2050	31,768	5,411,513	0.1
Series 4981, Class MI(i)	5.00%	06/25/2050	53,383	9,496,579	0.1
Series 4987, Class IC(i)	4.50%	06/25/2050	119,314	17,071,337	0.1
Series 4993, Class LI(i)	5.00%	07/25/2050	14,703	2,144,132	0.0
Series 5008, Class AI(i)	3.50%	09/25/2050	13,267	1,998,571	0.0
Series 5011, Class MI(i)	3.00%	09/25/2050	12,520	1,896,993	0.0
Series 5013, Class JI(i)	4.00%	09/25/2050	26,516	3,493,613	0.0
Series 5015, Class BI(i)	4.00%	09/25/2050	23,262	4,050,658	0.0
Series 5018, Class AI(i)	4.00%	10/25/2050	12,645	2,201,932	0.0
Series 5018, Class GI(i)	4.50%	10/25/2050	18,466	2,772,509	0.0
Series 5024, Class DI(i)	4.00%	10/25/2050	5,419	824,540	0.0
Series 5030, Class EI(i)	3.50%	10/25/2050	5,011	890,765	0.0
Series 5036, Class IT(i)	4.00%	03/25/2050	7,164	1,098,216	0.0
Series 5040, Class AI(i)	3.50%	11/25/2050	1,918	302,516	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 5040, Class CI(i)	4.00%	11/25/2050	USD 26,439	\$ 3,436,016	0.0%
Series 5043, Class IO(i)	5.00%	11/25/2050	15,638	2,912,267	0.0
Series 5049, Class CI(i)	3.50%	12/25/2050	23,941	3,065,379	0.0
Series 5052, Class IK(i)	4.00%	12/25/2050	21,893	3,255,737	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2020-96, Class KI(i)	2.50%	01/25/2051	6,293	725,000	0.0
Series 2021-18, Class IT(i)	3.00%	04/25/2051	15,352	1,583,536	0.0
Series 2020-76, Class GI(i)	4.00%	11/25/2050	16,850	2,382,935	0.0
Series 2020-89, Class KI(i)	4.00%	12/25/2050	70,585	10,396,396	0.1
Series 2015-49, Class LI(i)	5.00%	07/25/2045	14,213	2,283,558	0.0
Series 2016-26, Class IO(i)	5.00%	05/25/2046	14,552	2,421,139	0.0
Series 2010-109, Class IQ(i)	5.50%	08/25/2040	5,905	650,023	0.0
Series 2019-4, Class AI(i)	6.00%	08/25/2038	24,801	5,047,925	0.0
Series 2013-66, Class LI(i)	7.00%	07/25/2043	15,091	3,002,251	0.0
Government National Mortgage Association,					
Series 2021-41, Class UI(i)	3.50%	03/20/2051	30,058	4,033,179	0.0
				<u>104,631,486</u>	<u>0.5</u>
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2006-24CB, Class A16	5.75%	08/25/2036	1,560	1,202,037	0.0
Series 2007-15CB, Class A19	5.75%	07/25/2037	1,589	1,290,297	0.0
Series 2006-28CB, Class A18	6.00%	10/25/2036	894	643,741	0.0
Series 2007-16CB, Class 1A7	6.00%	08/25/2037	3,560	3,414,608	0.0
Series 2006-42, Class 1A6	6.00%	01/25/2047	2,827	2,198,098	0.0
Series 2006-26CB, Class A6	6.25%	09/25/2036	685	473,348	0.0
Series 2006-26CB, Class A8	6.25%	09/25/2036	2,592	1,791,036	0.0
Series 2006-28CB, Class A14	6.25%	10/25/2036	2,538	1,879,142	0.0
Series 2006-J5, Class 1A1	6.50%	09/25/2036	1,877	1,467,630	0.0
Bear Stearns ARM Trust, Series 2007-4, Class 22A1	3.28%	06/25/2047	7,652	7,655,199	0.1
ChaseFlex Trust, Series 2007-1, Class 1A3	6.50%	02/25/2037	4,522	2,461,237	0.0
CHL Mortgage Pass-Through Trust					
Series 2007-HY4, Class 1A1	2.97%	09/25/2047	2,215	2,125,288	0.0
Series 2007-3, Class A30	5.75%	04/25/2037	1,347	961,409	0.0
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2007-AR4,					
Class 1A1A	3.15%	03/25/2037	1,436	1,436,744	0.0
CitiMortgage Alternative Loan Trust, Series 2007-A3,					
Class 1A4	5.75%	03/25/2037	553	558,742	0.0
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust,					
Series 2006-13, Class 1A19	6.25%	09/25/2036	615	395,596	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
Series 2006-AA3, Class A1	2.54%	06/25/2036	2,047	1,871,813	0.0
Series 2006-FA3, Class A9	6.00%	07/25/2036	2,674	1,772,957	0.0
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2007-6XS,					
Class 2A5S	6.00%	02/25/2047	4,230	2,312,441	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust					
Series 2005-QA10, Class A31	3.83%	09/25/2035	4,238	3,707,489	0.1
Series 2005-QS14, Class 3A1	6.00%	09/25/2035	1,070	1,054,880	0.0
Residential Asset Securitization Trust					
Series 2006-A8, Class 3A4	6.00%	08/25/2036	2,528	1,801,607	0.0
Series 2007-A1, Class A8	6.00%	03/25/2037	3,968	2,138,089	0.0
Series 2007-A5, Class 2A3	6.00%	05/25/2037	1,104	885,545	0.0
Washington Mutual Mortgage Pass-Through Certificates Trust,					
Series 2006-3, Class 3CB4	6.00%	04/25/2036	519	519,441	0.0
				<u>46,018,414</u>	<u>0.2</u>
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2007-7T2, Class A3(f)	0.68%	04/25/2037	6,663	2,150,604	0.0
Citigroup Mortgage Loan Trust, Series 2005-8, Class 2A2(f) (h)	4.72%	09/25/2035	469	3,850	0.0
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust,					
Series 2007-13, Class A7(f)	0.68%	08/25/2037	2,347	992,065	0.0
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust,					
Series 2007-FA2, Class 1A6(f) (h)	5.47%	04/25/2037	1,826	511,607	0.0
Impac Secured Assets Corp., Series 2005-2, Class A2D(f)	0.94%	03/25/2036	1,581	1,421,536	0.0
Lehman XS Trust Series 2007-16N, Class 2A2(f)	0.93%	09/25/2047	2,206	2,252,786	0.1
Series 2007-10H, Class 2AIO(f) (h)	6.90%	07/25/2037	3,254	640,449	0.0
PHH Alternative Mortgage Trust, Series 2007-2, Class 1A3(f)	0.74%	05/25/2037	1,578	1,557,480	0.0
RBSGC Mortgage Loan Trust, Series 2007-B, Class 1A4(f)	0.53%	01/25/2037	963	391,244	0.0
Residential Accredit Loans, Inc. Trust, Series 2006-QS18,					
Class 2A2(f) (h)	6.47%	12/25/2036	7,304	1,297,489	0.0
				<u>11,219,110</u>	<u>0.1</u>
				<u>1,261,759,776</u>	<u>6.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB FCP I - Mortgage Income Portfolio - Class SA			1,755,037	\$ 140,262,524	0.7%
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			1,404,791	150,396,920	0.7
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S			4,017,647	112,212,879	0.6
AB SICAV I - Emerging Market Local Currency Debt Portfolio - Class ZT			17,296,128	210,839,804	1.0
AB SICAV I - Euro High Yield Portfolio - Class S			4,195,749	163,089,969	0.8
AB SICAV I - Financial Credit Portfolio - Class ZT			1,270,310	149,642,552	0.7
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			4,317,914	66,452,692	0.3
				<u>992,897,340</u>	<u>4.8</u>
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
STAATSANLEIHEN					
BRASILIEN					
Brazil Notas do Tesouro Nacional, Series F	10.00%	01/01/2023	BRL 2,266,808	445,857,504	2.1
KOLUMBIEN					
Colombian TES, Series B	5.75%	11/03/2027	COP 327,107,900	83,809,711	0.4
Colombian TES, Series B	7.50%	08/26/2026	130,000,000	36,526,166	0.2
Colombian TES, Series B	10.00%	07/24/2024	152,590,800	45,884,725	0.2
				<u>166,220,602</u>	<u>0.8</u>
ÄGYPTEN					
Egypt Government Bond, Series 5YR	14.06%	01/12/2026	EGP 419,000	25,830,723	0.1
MEXIKO					
Mexican Bonos, Series M	8.00%	09/05/2024	MXN 2,817,670	147,572,029	0.7
Mexican Bonos, Series M 20	7.50%	06/03/2027	2,235,601	115,521,522	0.6
				<u>263,093,551</u>	<u>1.3</u>
				<u>901,002,380</u>	<u>4.3</u>
SCHATZOBBLIGATIONEN					
INDONESIEN					
JPMorgan Chase Bank, NA	9.50%	05/17/2041	IDR 414,814,000	35,919,039	0.2
INDUSTRIE					
ENERGIE					
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR 2,500,000	34,585,488	0.1
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
HDFC Bank Ltd.	8.10%	03/22/2025	1,070,000	14,802,589	0.1
				<u>986,309,496</u>	<u>4.7</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
BAHRAIN					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	USD 4,456	4,927,500	0.0
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	1,131	1,232,914	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	1,209	1,408,334	0.0
				<u>2,641,248</u>	<u>0.0</u>
MEXIKO					
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	90,503	88,864,896	0.4
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	57,880	50,847,580	0.3
Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030	33,603	35,073,131	0.2
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	36,944	32,314,917	0.2
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	51,866	49,520,101	0.2
				<u>256,620,625</u>	<u>1.3</u>
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	3,367	3,449,702	0.0
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	2,883	3,055,980	0.0
				<u>6,505,682</u>	<u>0.0</u>
SÜDAFRIKA					
Eskom Holdings SOC Ltd.	4.31%	07/23/2027	4,162	4,182,810	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd.	6.35%	08/10/2028	7,156	7,947,454	0.1
Eskom Holdings SOC Ltd.	7.13%	02/11/2025	7,482	7,901,927	0.0
				<u>20,032,191</u>	<u>0.1</u>
TRINIDAD & TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	441	452,852	0.0

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
UKRAINE						
	NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.38%	07/19/2022	USD 10,054	\$ 10,356,002	0.1%
	State Savings Bank of Ukraine Via SSB #1 PLC	9.63%	03/20/2025	3,759	4,087,695	0.0
					<u>14,443,697</u>	<u>0.1</u>
VENEZUELA						
	Petroleos de Venezuela SA(c)	5.38%	04/12/2027	61,738	2,716,463	0.0
					<u>308,340,258</u>	<u>1.5</u>
INDUSTRIE						
ENERGIE						
	Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	7.63%	11/07/2024	17,099	18,940,563	0.1
	Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	8.38%	11/07/2028	14,848	17,152,224	0.1
					<u>36,092,787</u>	<u>0.2</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE						
	DP World Salaam(d)	6.00%	10/01/2025	21,915	23,961,312	0.1
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN						
	DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029	899	975,415	0.0
	DP World Ltd./United Arab Emirates	5.63%	09/25/2048	3,782	4,746,410	0.0
					<u>5,721,825</u>	<u>0.0</u>
					<u>65,775,924</u>	<u>0.3</u>
STAATSANLEIHEN						
UKRAINE						
	State Agency of Roads of Ukraine.....	6.25%	06/24/2028	35,107	35,229,874	0.2
					<u>409,346,056</u>	<u>2.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE						
BAHRAIN						
	Bahrain Government International Bond.....	5.45%	09/16/2032	2,327	2,280,460	0.0
	Bahrain Government International Bond.....	5.63%	09/30/2031	38,984	38,869,484	0.2
	Bahrain Government International Bond.....	6.75%	09/20/2029	17,385	18,855,119	0.1
	Bahrain Government International Bond.....	7.00%	10/12/2028	53,288	58,683,410	0.3
	Bahrain Government International Bond.....	7.38%	05/14/2030	6,009	6,680,506	0.0
	CBB International Sukuk Programme Co. WLL.....	6.25%	11/14/2024	6,455	7,000,851	0.0
					<u>132,369,830</u>	<u>0.6</u>
OMAN						
	Oman Government International Bond	4.13%	01/17/2023	10,826	11,051,316	0.1
	Oman Government International Bond	4.75%	06/15/2026	7,017	7,266,104	0.0
	Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	1,253	1,310,795	0.0
	Oman Government International Bond	5.38%	03/08/2027	4,890	5,159,867	0.0
	Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	32,548	35,395,950	0.2
	Oman Government International Bond	6.50%	03/08/2047	10,000	10,011,250	0.1
	Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	15,395	15,720,219	0.1
	Oman Government International Bond	7.00%	01/25/2051	9,560	9,942,400	0.0
					<u>95,857,901</u>	<u>0.5</u>
					<u>228,227,731</u>	<u>1.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN						
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
	Consolidated Energy Finance SA	6.50%	05/15/2026	5,585	5,643,292	0.0
	Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025	37,865	39,068,158	0.2
					<u>44,711,450</u>	<u>0.2</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE						
	Melco Resorts Finance Ltd.....	5.38%	12/04/2029	875	906,666	0.0
	Melco Resorts Finance Ltd.....	5.63%	07/17/2027	10,154	10,497,908	0.1
	MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	5,982	6,162,614	0.0
	MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024	7,461	7,645,395	0.0
	MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	6,242	6,524,061	0.0
	Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	2,548	2,503,092	0.0
	Studio City Finance Ltd.	6.00%	07/15/2025	9,535	9,942,025	0.0
	Studio City Finance Ltd.	6.50%	01/15/2028	10,680	11,173,950	0.1
	Wynn Macau Ltd.....	5.13%	12/15/2029	3,667	3,644,081	0.0
	Wynn Macau Ltd.....	5.50%	01/15/2026	16,527	16,904,313	0.1
	Wynn Macau Ltd.....	5.50%	10/01/2027	12,252	12,405,150	0.1
	Wynn Macau Ltd.....	5.63%	08/26/2028	10,091	10,226,230	0.1
					<u>98,535,485</u>	<u>0.5</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER						
	Teva Pharmaceutical Finance Netherlands III BV.....	7.13%	01/31/2025	21,515	23,617,538	0.1

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	5.75%	06/30/2023	USD 7,973	\$ 8,310,763	0.0%
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	7,639	8,320,652	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	13,968	15,412,544	0.1
				<u>32,043,959</u>	<u>0.2</u>
				<u>198,908,432</u>	<u>1.0</u>
FINANZINSTITUTE					
VERSICHERUNGEN					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(a)	7.63%	10/15/2025	7,297	7,733,900	0.0
				<u>206,642,332</u>	<u>1.0</u>
STAMMAKTIEN					
Avaya Holdings Corp.			377,239	7,608,911	0.0
Berry Corp.			2,589,382	15,536,292	0.1
Bonanza Creek Energy, Inc.			90,161	3,505,460	0.0
Carlson Travel, Inc.(j)			3,152	0	0.0
Denbury, Inc.			286,004	20,114,661	0.1
Gulfport Energy Operating Corp.			841,801	56,282,815	0.3
iHeartMedia, Inc. - Class A			542,779	13,504,342	0.1
SandRidge Energy, Inc.			3,888	34,603	0.0
Whiting Petroleum Corp.			207,753	9,754,003	0.0
WillScot Mobile Mini Holdings Corp.			323,192	9,566,483	0.0
				<u>135,907,570</u>	<u>0.6</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E.	4.80%	02/10/2036	USD 11,700	12,265,737	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1, Class XA(i)	1.15%	11/15/2050	5,666	239,371	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C8, Class XA(i)	1.71%	06/15/2050	9,096	590,436	0.0
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class XA(i)	1.50%	04/10/2046	23,260	401,129	0.0
Series 2014-GC23, Class D.	4.63%	07/10/2047	15,574	15,716,648	0.1
Series 2015-GC29, Class XA(i)	1.17%	04/10/2048	29,069	933,540	0.0
Series 2017-P8, Class XA(i)	1.04%	09/15/2050	46,897	2,103,779	0.0
Series 2018-C6, Class XA(i)	0.95%	11/10/2051	3,185	157,359	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,049	2,284,896	0.0
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	4,120	1,955,714	0.0
Series 2012-CR3, Class XA(i)	1.99%	10/15/2045	67,086	817,523	0.0
Series 2012-CR5, Class XA(i)	1.65%	12/10/2045	49,324	735,232	0.0
Series 2013-LC6, Class XA(i)	1.43%	01/10/2046	37,107	421,163	0.0
Series 2014-CR15, Class XA(i)	0.86%	02/10/2047	44,909	712,555	0.0
Series 2014-CR16, Class D	5.08%	04/10/2047	20,000	18,924,324	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(i)	1.15%	11/10/2047	48,413	1,316,424	0.0
Series 2016-DC2, Class XA(i)	1.11%	02/10/2049	36,792	1,274,123	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(i)	1.31%	09/10/2050	18,998	1,113,944	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2012-GC6, Class C	6.04%	01/10/2045	4,553	4,597,293	0.0
Series 2014-GC18, Class D	5.15%	01/10/2047	6,930	1,779,576	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(i)	1.26%	08/10/2050	57,572	2,870,423	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C14, Class D	4.70%	08/15/2046	3,001	2,275,172	0.0
Series 2013-C15, Class XA(i)	1.21%	11/15/2045	30,142	536,941	0.0
Series 2014-C21, Class XA(i)	1.12%	08/15/2047	59,507	1,440,201	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2012-C6, Class XA(i)	1.75%	11/15/2045	35,770	322,553	0.0
Series 2015-C22, Class XA(i)	1.16%	04/15/2048	67,888	1,876,796	0.0
Series 2016-C30, Class XA(i)	1.52%	09/15/2049	60,832	3,390,431	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2016-BNK2, Class XA(i)					
UBS Commercial Mortgage Trust	1.15%	11/15/2049	77,553	3,219,930	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2017-C2, Class XA(i)	1.20%	08/15/2050	3,086	146,667	0.0
Series 2018-C10, Class XA(i)	1.11%	05/15/2051	85,165	4,296,358	0.0
Series 2018-C14, Class XA(i)	1.16%	12/15/2051	49,412	2,893,218	0.0
Series 2018-C15, Class XA(i)	1.09%	12/15/2051	102,148	5,539,326	0.1
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2016-C33, Class XA(i)	1.78%	03/15/2059	59,429	3,636,202	0.0
Series 2016-C35, Class XA(i)	2.05%	07/15/2048	5,151	383,812	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(i)	1.76%	10/15/2049	87,857	5,750,289	0.1
Series 2017-C38, Class XA(i)	1.16%	07/15/2050	26,040	1,185,536	0.0
Series 2018-C48, Class XA(i)	1.11%	01/15/2052	31,689	1,819,367	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C10, Class XA(i)	1.64%	12/15/2045	USD 90,463	\$ 1,277,225	0.0%
Series 2012-C7, Class XA(i)	1.45%	06/15/2045	22,432	78,386	0.0
Series 2012-C8, Class F	5.05%	08/15/2045	8,767	7,049,723	0.1
Series 2012-C8, Class XA(i)	1.94%	08/15/2045	26,069	190,677	0.0
Series 2013-C11, Class XA(i)	1.28%	03/15/2045	64,707	777,218	0.0
Series 2014-C20, Class D	3.99%	05/15/2047	4,799	2,111,521	0.0
				<u>121,408,738</u>	<u>0.6</u>
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class E(f)	4.85%	05/15/2036	5,780	3,839,895	0.0
				<u>125,248,633</u>	<u>0.6</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABLE VERZINSLICH					
AGL CLO Ltd., Series 2021-10A, Class E(f)	6.19%	04/15/2034	5,000	5,000,460	0.0
AGL CLO Ltd., Series 2021-11A, Class E(f)	6.52%	04/15/2034	4,063	4,076,483	0.0
AGL CLO Ltd., Series 2021-12A, Class E(f)	6.28%	07/20/2034	2,500	2,439,385	0.0
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(f)	5.95%	04/20/2034	3,000	3,004,551	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class D(f)	7.13%	01/20/2034	1,750	1,751,718	0.0
Ballyrock CLO Ltd., Series 2021-17A, Class D(f)	6.10%	10/20/2034	5,030	4,954,550	0.0
Benefit Street Partners CLO Ltd., Series 2020-22A, Class E(f)	7.13%	01/20/2032	1,188	1,188,000	0.0
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(f)	5.48%	04/20/2031	550	536,113	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(f)	6.43%	07/18/2030	3,732	3,719,492	0.0
Dryden CLO Ltd., Series 2018-57A, Class E(f)	5.32%	05/15/2031	6,004	5,750,331	0.1
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(f)	6.63%	04/15/2034	3,600	3,563,374	0.0
Jamestown CLO XI Ltd., Series 2018-11A, Class D(f)	6.15%	07/14/2031	1,250	1,194,453	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class E(f)	7.33%	01/20/2032	2,250	2,252,331	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-42A, Class E(f)	6.09%	07/16/2035	2,750	2,749,744	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-44A, Class E(f)	6.12%	10/16/2034	750	750,000	0.0
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(f)	5.43%	01/17/2031	2,933	2,692,442	0.0
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(f)	6.12%	10/20/2034	3,700	3,700,000	0.0
Pikes Peak CLO, Series 2018-2A, Class E(f)	6.33%	01/18/2032	5,170	5,110,788	0.0
Pipk, Series 2021-8A, Class E(f)	6.61%	07/20/2034	8,350	8,275,518	0.1
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(f)	6.08%	07/15/2031	7,200	6,768,583	0.1
Rockford Tower CLO Ltd., Series 2021-1A, Class E(f)	6.44%	07/20/2034	2,000	1,954,018	0.0
				<u>71,432,334</u>	<u>0.3</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	5,645	10,010,511	0.1
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	21,250	27,705,871	0.1
Wisconsin Public Finance Authority, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	15,804,375	0.1
				<u>53,520,757</u>	<u>0.3</u>
VORZUGSAKTIE					
FINANZINSTITUTE					
VERSICHERUNGEN					
Hartford Financial Services Group, Inc. (The)	7.88%		655,525	17,286,194	0.1
INDUSTRIE					
ENERGIE					
Gulfport Energy Operating Corp.(a) (b)	10.00%		2,552	12,249,600	0.0
Targa Resources Corp., Series A	9.50%		20,939	22,479,671	0.1
				<u>34,729,271</u>	<u>0.1</u>
				<u>52,015,465</u>	<u>0.2</u>
ABS-ANLEIHEN					
BAUSPARDARLEHEN – FESTVERZINSLICH					
CSAB Mortgage-Backed Trust, Series 2006-2, Class A6A	6.22%	09/25/2036	USD 7,346	3,432,380	0.0
CWABS Asset-Backed Certificates Trust, Series 2005-7, Class AF5W	5.55%	10/25/2035	5,067	5,104,110	0.1
GSAA Home Equity Trust					
Series 2006-10, Class AF3	5.98%	06/25/2036	4,393	1,806,904	0.0
Series 2005-12, Class AF5	6.16%	09/25/2035	2,389	2,032,506	0.0
Series 2006-6, Class AF4	6.62%	03/25/2036	933	387,091	0.0
Series 2006-6, Class AF5	6.74%	03/25/2036	7,941	3,294,210	0.0
Lehman XS Trust, Series 2007-6, Class 3A5(f)	4.48%	05/25/2037	725	740,002	0.0
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2006-17XS, Class A6	5.58%	10/25/2046	6,607	2,457,190	0.0
				<u>19,254,393</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
OPTIONSSCHEINE					
Avaya Holdings Corp., expiring 12/15/2022			750,462	\$ 1,838,632	0.0%
BEZUGSRECHTE					
Vistra Energy Corp., expiring 12/31/2049			454,387	578,435	0.0
				<u>19,618,505,646</u>	<u>94.2</u>
GELDMARKTINSTRUMENTE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
ÄGYPTEN					
Egypt Treasury Bills, Series 364D	0.00%	01/04/2022	EGP 1,299,375	79,193,596	0.4
				<u>19,697,699,242</u>	<u>94.6</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
STAMMAKTIE					
Ag Tracker (j)			1,277,171	1	0.0
ATD New Holdings, Inc. (j)			525,684	35,615,091	0.1
Battalion Oil Corp.			393	4,174	0.0
BIS Industries Holdings Ltd. (j)			10,224,003	10	0.0
CHC Group LLC			5,251,140	105,548	0.0
Diamond Offshore Drilling, Inc. (j)			3,002,103	15,010,515	0.1
Exide Corp. (j)			6,006	13,063,050	0.1
Golo Mobile, Inc. (j)			485,119	11,535	0.0
K201640219 South Africa Ltd. A Shares (j)			193,371,375	193	0.0
K201640219 South Africa Ltd. B Shares (j)			30,622,211	31	0.0
Monitronics International, Inc. (j)			407,250	3,119,535	0.0
Monitronics International, Inc.			405,564	3,106,620	0.0
Mt. Logan Re Ltd. (Preference Shares) (Series 1) (j)			29,000	29,940,888	0.1
Mt. Logan Re Ltd. (Preference Shares) (Series 2) (j)			44,086	43,000,575	0.2
Neenah Enterprises, Inc. (j)			504,400	1	0.0
New Cotai LLC/New Cotai Capital Corp. (j)			63	0	0.0
Paragon Offshore Ltd. - Class A (j)			218,935	21,893	0.0
Paragon Offshore Ltd. - Class B (j)			328,403	3,284,030	0.0
Paysafe Ltd.			1,617,484	13,683,915	0.1
Southeastern Grocers, Inc. (j)			2,612,161	57,467,542	0.3
Vantage Drilling International			266,094	598,711	0.0
				<u>218,033,858</u>	<u>1.0</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Commercial Mortgage Trust, Series 2012-CR3, Class F	4.75%	10/15/2045	USD 3,626	577,057	0.0
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-GC17(j)	4.49%	09/15/2048	555	11,303,888	0.0
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(j)	0.00%	03/10/2047	469	6,559,969	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(j)	4.00%	04/15/2050	1,006	13,434,511	0.0
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(j)	4.00%	11/15/2047	1,109	11,553,793	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(j)	3.40%	10/15/2057	581	7,544,555	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	2,801	1,435,598	0.0
Series GT-E1(j)	3.49%	07/10/2046	69	2,565,931	0.0
Series GT-E2(j)	3.49%	07/10/2046	164	6,144,766	0.1
Series GT-F3(j)	3.49%	07/10/2046	155	7,099,987	0.1
Series GT-F4(j)	3.49%	07/10/2046	41	2,419,254	0.0
Series GT-G1(j)	3.49%	07/10/2046	636	7,732,513	0.1
Series GT-G2(j)	3.49%	07/10/2046	386	10,436,006	0.1
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-LC9, Class G	4.51%	12/15/2047	13,837	10,180,888	0.1
				<u>98,988,716</u>	<u>0.5</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Exide Global Holding NETH(j)	10.75%	10/26/2024	7,759	7,611,527	0.0
SNS Bank NV, Series E(d) (j)	11.25%	12/31/2049	EUR 7,579	0	0.0
				<u>7,611,527</u>	<u>0.0</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Magnetation LLC/Mag Finance Corp.(j) (k)	11.00%	05/15/2018	USD 40,106	0	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide Technologies, (Exchange Priority)(j)	11.00%	10/31/2024	27,457	0	0.0
Exide Technologies, (First Lien)(j)	11.00%	10/31/2024	11,269	0	0.0
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	10.13%	02/01/2026	EUR 12,307	16,619,209	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./New Albertsons LP/ Albertsons LLC	7.50%	03/15/2026	USD 5,667	\$ 6,173,054	0.1%
Sunshine Mid BV	6.50%	05/15/2026	EUR 18,558	22,684,971	0.1
				<u>28,858,025</u>	<u>0.2</u>
ENERGIE					
Diamond Foreign Asset Co./Diamond Finance LLC(a)	9.00%	04/22/2027	USD 2,012	1,992,177	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.00%	10/15/2024	24,233	969,320	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.38%	05/15/2025	28,214	1,128,560	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.38%	01/15/2026	20,769	830,760	0.0
Gulfport Energy Corp.	6.63%	05/01/2023	3,218	128,720	0.0
Vantage Drilling International(j)	7.13%	04/01/2023	16,605	0	0.0
Vantage Drilling International(j) (k)	7.50%	11/01/2019	33,306	0	0.0
				<u>5,049,537</u>	<u>0.0</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Carlson Travel, Inc.	6.75%	12/15/2025	17,815	15,876,640	0.1
Carlson Travel, Inc.	10.50%	03/31/2025	3,154	3,287,853	0.0
Monitronics International, Inc.(j) (k)	9.13%	04/01/2020	21,822	0	0.0
				<u>19,164,493</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Modulaire Global Finance PLC	6.50%	02/15/2023	EUR 3,111	3,747,733	0.0
				<u>73,438,997</u>	<u>0.4</u>
				<u>81,050,524</u>	<u>0.4</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
INDUSTRIE					
INVESTITIONSGÜTER					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	USD 45,768	228,841	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Tonon Luxembourg SA(a) (c) (j)	6.50%	10/31/2024	4,667	47,141	0.0
USJ-Acucar e Alcool S/A(c)	9.88%	11/09/2023	16,713	5,181,087	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(k)	10.50%	01/28/2018	27,458	274,580	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(k)	10.88%	01/13/2020	8,270	1,033,750	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(c)	11.75%	02/09/2022	32,498	162,490	0.0
				<u>6,699,048</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
K2016470219 South Africa Ltd.(a) (j)	3.00%	12/31/2022	16,266	0	0.0
K2016470260 South Africa Ltd.(a) (j)	25.00%	12/31/2022	9,282	0	0.0
				<u>0</u>	<u>0.0</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Digicel Group Holdings Ltd.(a)	10.00%	04/01/2024	48,077	47,732,360	0.3
Digicel Group Holdings Ltd.(a)	8.00%	04/01/2025	5,517	4,766,022	0.0
				<u>52,498,382</u>	<u>0.3</u>
				<u>59,426,271</u>	<u>0.3</u>
VERSORGBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	2,777	2,858,060	0.0
				<u>62,284,331</u>	<u>0.3</u>
SCHWELLENMÄRKTE – LOKALE WÄHRUNG					
INFLATIONSgebundene Wertpapiere					
KOLUMBIEN					
Fideicomiso PA Costera	6.25%	01/15/2034	COP 18,690,784	5,167,314	0.0
Fideicomiso PA Pacifico Tres	7.00%	01/15/2035	97,872,936	28,283,088	0.2
				<u>33,450,402</u>	<u>0.2</u>
STAATSANLEIHEN					
DOMINIKANISCHE REPUBLIK					
Dominican Republic International Bond	12.00%	01/20/2022	DOP 477,260	8,625,742	0.0
				<u>42,076,144</u>	<u>0.2</u>
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2019-43, Class PT	5.72%	11/15/2044	USD 2,660	2,632,577	0.0
Series 2019-24, Class PT	10.35%	08/15/2044	3,763	3,773,773	0.0
Series 2018-20, Class PT	11.71%	11/16/2043	1,247	1,253,067	0.0
Series 2019-36, Class PT	12.76%	10/17/2044	5,751	5,806,044	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-12, Class PT	10.00%	06/15/2043	USD 796	\$ 791,328	0.0%
Series 2018-4, Class PT	12.10%	05/15/2043	502	497,959	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust, Series 2018-3, Class PT	12.08%	03/16/2043	299	293,972	0.0
SoFi Consumer Loan Program LLC					
Series 2016-1, Class R(j)	0.00%	08/25/2025	3,791	1,810,388	0.0
Series 2017-3, Class R(j)	0.00%	05/25/2026	159	7,017,016	0.1
Series 2017-5, Class R1(j)	0.00%	09/25/2026	225	4,717,503	0.0
SoFi Consumer Loan Program Trust, Series 2018-1, Class R1(j)	0.00%	02/25/2027	355	9,457,965	0.1
				<u>38,051,592</u>	<u>0.2</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 9 Ltd., Series 2020-9A, Class E(f)	7.39%	01/20/2034	2,000	2,008,872	0.0
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(f)	6.33%	04/15/2033	1,752	1,751,715	0.0
Bardot CLO Ltd., Series 2019-2A, Class C(f)	2.89%	10/22/2032	1,500	1,501,908	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class ER(f)	6.28%	10/20/2030	7,000	6,954,115	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO 29 Ltd., Series 2018-29A, Class D(f)	3.23%	10/19/2031	3,000	2,999,988	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class D(f)	3.93%	10/16/2032	1,875	1,878,557	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2019-33A, Class E(f)	6.93%	10/16/2032	1,500	1,500,959	0.0
Octagon Investment Partners 30 Ltd., Series 2017-1A, Class D(f)	6.33%	03/17/2030	1,000	986,293	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class E(f)	5.63%	04/15/2031	10,000	9,256,280	0.1
Pikes Peak CLO 7, Series 2021-7A, Class E(f)	6.88%	02/25/2034	3,000	3,000,798	0.0
York CLO-3 Ltd., Series 2016-1A, Class ER(f)	6.53%	10/20/2029	438	424,402	0.0
				<u>32,263,887</u>	<u>0.2</u>
VORZUGSAKTIEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Exide International Holdings LP(j)	0.00%		21,353	17,189,165	0.1
ENERGIE					
Gulfport Energy Corp.(b) (j)	0.00%		108	518,400	0.0
				<u>17,707,565</u>	<u>0.1</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Lloyds Banking Group PLC(d)	6.00%	06/07/2032	GBP 4,459	5,798,967	0.1
VERSICHERUNGEN					
Nationwide Mutual Insurance Co.(f)	2.41%	12/15/2024	USD 5,000	5,029,615	0.0
				<u>10,828,582</u>	<u>0.1</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd., Series 2019-4A, Class B1(f)	3.93%	10/25/2029	6,083	5,983,657	0.0
Radnor Re Ltd., Series 2020-1, Class B1(f)	3.08%	01/25/2030	1,862	1,850,456	0.0
				<u>7,834,113</u>	<u>0.0</u>
OPTIONSSCHEINE					
Battalion Oil Corp., expiring 10/08/2022(j)			7,289	0	0.0
SandRidge Energy, Inc., A-CW22, expiring 10/03/2022			94,880	1,433	0.0
SandRidge Energy, Inc., B-CW22, expiring 10/03/2022			39,948	1,198	0.0
Willscot Corp., expiring 11/29/2022(j)			500,414	7,225,928	0.0
				<u>7,228,559</u>	<u>0.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Digicel Group Holdings Ltd.(a) (d)	7.00%	09/15/2021	USD 1,254	986,025	0.0
				<u>617,333,896</u>	<u>3.0</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$20,186,595,298)				\$ 20,315,033,138	97.6%
Termineinlagen					
ANZ, London(l)	(0.13)%	–		186,166	0.0
BBH, Grand Cayman(l)	4.00 %	–		24,115	0.0
BNP Paribas, Paris(l)	0.01 %	–		145,086	0.0
BNP Paribas, Paris(l)	0.01 %	–		14,624,848	0.1
BNP Paribas, Paris(l)	4.00 %	–		21,952,118	0.1
DBS Bank Ltd, Singapore(l)	0.01 %	–		538,187,188	2.6
Deutsche Bank, Frankfurt(l)	(0.78)%	–		3,014,597	0.0

	Zinssatz	Datum	Wert (USD)	Nettovermögen %
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(l).....	0.00 %	–	\$ 416,304	0.0%
Sumitomo, London(l).....	0.01 %	–	72,016	0.0
Sumitomo, Tokyo(l).....	0.01 %	–	116,464,964	0.6
Termineinlagen insgesamt			<u>695,087,402</u>	<u>3.4</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten			<u>(204,174,626)</u>	<u>(1.0)</u>
Nettovermögen			<u>\$ 20,805,945,914</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/31/2021	3,613	\$ 446,454,680	\$ 446,995,844	\$ 541,164
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/21/2021	4,132	549,065,000	551,428,313	2,363,313
Short					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	12/21/2021	209	33,964,407	34,060,470	(96,063)
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/21/2021	273	53,678,859	53,857,781	(178,922)
					<u>\$ 2,629,492</u>
				Wertsteigerung	\$ 2,904,477
				Wertminderung	\$ (274,985)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Bank of America, NA.....	RUB 6,528,789	USD 87,439	09/30/2021	\$ (1,345,968)
Bank of America, NA.....	USD 80,633	RUB 5,978,717	09/30/2021	672,129
Bank of America, NA.....	INR 3,612,019	USD 47,892	10/08/2021	(1,407,942)
Barclays Bank PLC.....	USD 40,629	ZAR 609,874	09/16/2021	1,273,049
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 772,612	AUD 1,053,385	09/08/2021	(1,985,575)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 50,153	CAD 63,115	09/08/2021	(127,922)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 48,979	CNH 320,046	09/08/2021	604,477
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 75,225	GBP 54,244	09/08/2021	(646,966)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 111,216	SGD 151,259	09/08/2021	1,287,326
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 590,082	ZAR 8,800,795	09/08/2021	15,288,741
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 677,719	AUD 918,095	09/13/2021	(6,044,916)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 50,153	CAD 62,706	09/13/2021	(452,012)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 50,412	CNH 327,884	09/13/2021	360,428
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 130,704	EUR 111,258	09/13/2021	691,223
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 75,224	GBP 54,269	09/13/2021	(611,099)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,523	PLN 5,940	09/13/2021	28,109
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 104,644	SGD 141,888	09/13/2021	889,613
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 456,865	ZAR 6,736,186	09/13/2021	6,158,180
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 733,319	AUD 1,012,270	10/01/2021	7,342,032
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 1,268	CHF 1,165	10/01/2021	4,664
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 148,683	EUR 126,559	10/01/2021	842,942
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 121,380	NZD 174,892	10/01/2021	1,857,522
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 371,868	ZAR 5,566,756	10/01/2021	9,810,472
Citibank, NA.....	COP 863,479,626	USD 223,835	09/16/2021	(5,089,612)
Citibank, NA.....	USD 30,697	ZAR 453,843	09/16/2021	484,163
Goldman Sachs Bank USA.....	BRL 2,458,109	USD 473,437	09/02/2021	(1,945,644)
Goldman Sachs Bank USA.....	USD 20,661	ZAR 303,626	09/16/2021	199,809
Goldman Sachs Bank USA.....	ZAR 2,824,367	USD 203,018	09/16/2021	8,968,476
Goldman Sachs Bank USA.....	GBP 38,644	USD 53,077	11/10/2021	(59,452)
HSBC Bank USA.....	IDR 599,686,176	USD 40,733	10/15/2021	(1,282,390)
HSBC Bank USA.....	EUR 329,383	USD 387,857	11/24/2021	(1,696,835)
Morgan Stanley & Co., Inc.....	USD 469,105	BRL 2,458,109	09/02/2021	6,277,955
Morgan Stanley & Co., Inc.....	CAD 37,036	USD 29,716	09/24/2021	362,188
Morgan Stanley & Co., Inc.....	BRL 2,458,109	USD 467,099	10/04/2021	(6,146,300)
Royal Bank of Scotland PLC.....	USD 78,227	ZAR 1,183,167	09/16/2021	3,063,085
UBS AG.....	USD 6,789	ZAR 100,220	09/16/2021	96,276
UBS AG.....	MXN 5,750,252	USD 280,541	10/28/2021	(3,557,758)
UBS AG.....	EUR 340,305	USD 404,544	11/08/2021	2,199,385
				<u>\$ 36,361,853</u>
			Wertsteigerung	\$ 68,762,244
			Wertminderung	\$ (32,400,391)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

VERKAUFTE ZINS-SWAPTIONS

Bezeichnung	Ausübungspreis	Fälligkeit	Nominalbetrag (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Put - OTC - 1 Year Interest Rate Swap	1.25 %	9/20/21	107,800	\$ 883,960	\$ (1,158,500)
Put - OTC - 1 Year Interest Rate Swap	1.28 %	9/23/21	107,950	909,479	(1,020,037)
Insgesamt				<u>\$1,793,439</u>	<u>\$ (2,178,537)</u>

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nominalbetrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Kaufkontrakte					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 27, 5 Year Index	06/20/2022	EUR 4	\$ (146)	\$ (50)
Verkaufskontrakte					
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	06/20/2026	USD 1,993,490	195,525,725	21,844,13
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	Ford Motor Company	06/20/2023	6,370	433,635	771,714
Morgan Stanley & Co. LLC/(INTRCONX)	iTraxx-XOVER Series 35, 5 Year Index	06/20/2026	EUR 682,700	98,472,603	15,708,910
Insgesamt				<u>\$ 294,431,817</u>	<u>\$ 38,324,709</u>
				Wertminderung	\$ 38,324,759
				Wertminderung	\$ (50)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschlussdatum	Nominalbetrag (000)	Marktwert	Vorabgebühren bezahlt/(erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 21,810	\$ (9,642,105)	\$ (10,583,943)	\$ 941,838
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	11,566	(5,113,412)	(5,702,530)	589,118
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,415	(1,067,786)	(306,793)	(760,993)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(728,301)	(1,407,270)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(73,246)	(2,062,325)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,661	(4,271,143)	(1,354,111)	(2,917,032)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,661	(4,271,143)	81,282	(4,352,425)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	18,003	(7,959,274)	(2,823,150)	(5,136,124)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	24,153	(10,677,857)	(5,253,834)	(5,424,023)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,200	(328,440)	(133,354)	(195,086)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,650	(451,605)	(225,617)	(225,988)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(638,070)	(730,430)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,259	(1,986,788)	(783,820)	(1,202,968)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,661	(4,271,143)	(2,129,575)	(2,141,568)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	206,980	(91,505,816)	(47,785,073)	(43,720,743)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,600	(985,320)	(386,354)	(598,966)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,562	(5,354,119)	(1,988,858)	(3,365,261)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	119,200	(32,625,040)	(11,324,967)	(21,300,073)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,000	(821,100)	(303,895)	(517,205)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,000	(821,100)	(301,905)	(519,195)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,124	(1,128,739)	(439,951)	(688,788)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,066	(1,660,264)	(683,368)	(976,896)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,192,387)	(1,544,613)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,362	(1,928,421)	(2,114,015)	185,594
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,362	(1,928,421)	(2,114,015)	185,594
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,661	(4,271,143)	(1,418,546)	(2,852,597)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	92,290	(40,801,372)	(18,329,229)	(22,472,143)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	293,908	(129,936,704)	(55,534,580)	(74,402,124)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	32	(8,758)	(4,375)	(4,383)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,439	(1,214,954)	(1,158,733)	(56,221)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,439	(1,214,954)	(965,856)	(249,098)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,123	(581,065)	(220,259)	(360,806)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,878	(2,429,909)	(1,995,724)	(434,185)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,878	(2,429,909)	(1,995,724)	(434,185)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	22,195	(6,074,771)	(5,471,797)	(602,974)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(498,026)	(870,474)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,491	(2,323,987)	(874,594)	(1,449,393)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(4,105,500)	(2,076,560)	(2,028,940)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	17,348	(4,748,148)	(1,798,838)	(2,949,310)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(3,417,242)	(3,425,258)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	87,751	(24,017,449)	(13,088,941)	(10,928,508)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(677,055)	(1,458,516)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,661	(4,271,143)	(1,354,111)	(2,917,032)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(682,868)	(685,632)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,862	(1,330,729)	(492,195)	(838,534)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	USD 5,000	\$ (1,368,500)	\$ (520,702)	\$ (847,798)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,476,205)	(1,260,795)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,380,977)	(1,356,023)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,035,644)	(1,701,356)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(4,105,500)	(2,219,250)	(1,886,250)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(4,105,500)	(2,048,605)	(2,056,895)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(5,474,000)	(2,803,119)	(2,670,881)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(3,690,513)	(3,151,987)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	50,000	(13,685,000)	(6,986,155)	(6,698,845)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	8,724	(3,856,842)	(4,138,033)	281,191
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,757	(2,987,237)	(3,024,769)	37,532
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,856	(1,704,613)	(1,640,289)	(64,324)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,757	(2,987,237)	(2,795,157)	(192,080)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,757	(2,987,237)	(2,778,811)	(208,426)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,756	(2,986,810)	(2,762,070)	(224,740)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,756	(2,986,810)	(2,745,727)	(241,083)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,710	(3,408,799)	(2,796,129)	(612,670)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,710	(3,408,799)	(2,777,664)	(631,135)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(443,085)	(1,692,486)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	22,195	(6,074,772)	(5,900,585)	(174,187)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,300	(355,810)	(168,012)	(187,798)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,370,027)	(1,366,973)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,552	(3,161,782)	(1,154,902)	(2,006,880)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,010	(5,203,037)	(1,919,114)	(3,283,923)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,365	(5,573,901)	(2,140,942)	(3,432,959)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(3,321,258)	(3,521,242)
Insgesamt				<u>\$ (541,842,001)</u>	<u>\$ (275,382,847)</u>	<u>\$(266,459,154)</u>
					Wertsteigerung	\$ 2,220,867
					Wertminderung	\$(268,680,021)
Swaps insgesamt						<u>\$(228,134,445)</u>

- (a) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (b) Wandelbares Wertpapier.
- (c) Not leidend.
- (d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (e) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. August 2021.
- (f) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. August 2021.
- (g) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
- (h) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (i) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (j) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (k) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (l) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- BRL – Brazilian Real
- CAD – Canadian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- CNH – Chinese Yuan Renminbi (Offshore)
- COP – Colombian Peso
- DOP – Dominican Peso
- EGP – Egyptian Pound
- EUR – Euro
- GBP – Great British Pound
- IDR – Indonesian Rupiah
- INR – Indian Rupee

MXN – Mexican Peso
NZD – New Zealand Dollar
PLN – Polish Zloty
RUB – Russian Ruble
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

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

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
VEREINIGTE STAATEN					
U.S. Treasury Bonds(a)	1.13%	08/15/2040	USD 290,549	\$ 257,862,237	1.0%
U.S. Treasury Bonds(a)	6.00%	02/15/2026	52,260	64,426,658	0.3
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	11/15/2027	737,372	967,339,368	3.9
U.S. Treasury Bonds(a)	6.13%	08/15/2029	854,728	1,180,593,464	4.7
U.S. Treasury Bonds	6.25%	05/15/2030	766,144	1,087,445,924	4.4
U.S. Treasury Bonds	6.75%	08/15/2026	635,560	819,971,674	3.3
U.S. Treasury Bonds	6.88%	08/15/2025	100,000	124,453,120	0.5
U.S. Treasury Bonds	7.50%	11/15/2024	129,580	158,775,994	0.6
U.S. Treasury Bonds	7.63%	02/15/2025	390,000	485,184,375	2.0
U.S. Treasury Notes	0.50%	10/31/2027	12,892	12,533,830	0.1
U.S. Treasury Notes	0.88%	06/30/2026	637,858	641,545,585	2.6
				<u>5,800,132,229</u>	<u>23.4</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Alcoa Nederland Holding BV	6.13%	05/15/2028	3,115	3,389,178	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	6.75%	03/15/2026	2,879	3,087,296	0.0
Cleveland-Cliffs, Inc.	9.88%	10/17/2025	21,096	24,559,488	0.1
FMG Resources August 2006 Pty Ltd.	4.50%	09/15/2027	9,573	10,388,574	0.1
Freeport-McMoRan, Inc.	5.40%	11/14/2034	9,609	11,942,147	0.1
Graphic Packaging International LLC	4.75%	07/15/2027	4,299	4,654,800	0.0
Grinding Media, Inc./Moly-Cop AltaSteel Ltd.	7.38%	12/15/2023	3,392	3,444,508	0.0
Intelligent Packaging Ltd. Finco, Inc./Intelligent Packaging Ltd. Co-Issuer LLC	6.00%	09/15/2028	29,713	31,047,779	0.1
Joseph T Ryerson & Son, Inc.	8.50%	08/01/2028	10,764	11,996,767	0.1
OCI NV	5.25%	11/01/2024	29,446	30,387,304	0.1
Olin Corp.	5.63%	08/01/2029	26,838	29,638,283	0.1
Peabody Energy Corp.(b)	8.50%	12/31/2024	5,406	4,293,176	0.0
PIC AU Holdings LLC/PIC AU Holdings Corp.	10.00%	12/31/2024	6,034	6,003,830	0.0
SPCM SA	4.88%	09/15/2025	7,338	7,484,431	0.1
WR Grace & Co-Conn.	4.88%	06/15/2027	6,793	7,047,901	0.0
				<u>189,365,462</u>	<u>0.8</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Ardagh Packaging Finance PLC/Ardagh Holdings USA, Inc.	5.25%	04/30/2025	7,709	8,065,541	0.0
Clean Harbors, Inc.	5.13%	07/15/2029	6,001	6,574,607	0.0
Colfax Corp.	6.38%	02/15/2026	2,729	2,869,173	0.0
Griffon Corp.	5.75%	03/01/2028	34,252	36,407,349	0.2
JELD-WEN, Inc.	4.63%	12/15/2025	9,455	9,610,346	0.0
Moog, Inc.	4.25%	12/15/2027	7,000	7,214,907	0.0
SPX FLOW, Inc.	5.88%	08/15/2026	1,900	1,955,822	0.0
Stevens Holding Co., Inc.	6.13%	10/01/2026	4,933	5,314,979	0.0
TK Vertical US Newco, Inc.	5.25%	07/15/2027	26,495	27,981,020	0.1
Triumph Group, Inc.	6.25%	09/15/2024	13,414	13,573,233	0.1
Triumph Group, Inc.	8.88%	06/01/2024	9,331	10,280,480	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.13%	06/15/2025	12,456	13,396,053	0.1
Wesco Distribution, Inc.	7.25%	06/15/2028	9,211	10,254,321	0.0
				<u>153,497,831</u>	<u>0.6</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Advantage Sales & Marketing, Inc.	6.50%	11/15/2028	37,082	38,830,709	0.2
Altice Financing SA	5.00%	01/15/2028	27,955	27,897,104	0.1
Altice Financing SA	5.75%	08/15/2029	24,913	25,543,975	0.1
Altice France SA/France	7.38%	05/01/2026	9,865	10,257,700	0.0
Banjay Entertainment SASU	5.38%	03/01/2025	8,926	9,161,676	0.0
Belo Corp.	7.75%	06/01/2027	2,604	3,059,029	0.0
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	08/15/2030	11,854	12,396,798	0.1
CCO Holdings LLC/CCO Holdings Capital Corp.	4.50%	06/01/2033	63,459	65,764,992	0.3
Clear Channel Worldwide Holdings, Inc.	5.13%	08/15/2027	14,724	15,148,501	0.1
CSC Holdings LLC	5.00%	11/15/2031	12,026	12,001,764	0.1
CSC Holdings LLC	5.75%	01/15/2030	18,428	19,468,664	0.1
DISH DBS Corp.	5.13%	06/01/2029	30,746	30,608,034	0.1
DISH DBS Corp.	5.88%	11/15/2024	357	385,797	0.0
DISH DBS Corp.	7.75%	07/01/2026	5,157	5,904,695	0.0
iHeartCommunications, Inc.	5.25%	08/15/2027	4,836	5,070,970	0.0
Lamar Media Corp.	4.88%	01/15/2029	6,462	6,899,423	0.0
LCPR Senior Secured Financing DAC	6.75%	10/15/2027	60,417	64,392,346	0.3
Liberty Interactive LLC	8.25%	02/01/2030	2,000	2,255,600	0.0
Mav Acquisition Corp.	5.75%	08/01/2028	37,341	37,255,116	0.2
Meredith Corp.	6.88%	02/01/2026	10,818	11,232,884	0.0
National CineMedia LLC	5.88%	04/15/2028	14,789	13,015,260	0.1
Sinclair Television Group, Inc.	5.50%	03/01/2030	22,785	22,315,543	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Sirius XM Radio, Inc.	3.88%	09/01/2031	USD 10,359	\$ 10,314,223	0.0%
Sirius XM Radio, Inc.	5.38%	07/15/2026	1,182	1,213,772	0.0
Sirius XM Radio, Inc.	5.50%	07/01/2029	22,137	24,226,806	0.1
Summer BC Bidco B LLC	5.50%	10/31/2026	3,700	3,761,637	0.0
TEGNA, Inc.	5.00%	09/15/2029	23,710	25,118,268	0.1
Univision Communications, Inc.	4.50%	05/01/2029	12,802	12,986,008	0.1
Univision Communications, Inc.	5.13%	02/15/2025	549	558,271	0.0
Univision Communications, Inc.	6.63%	06/01/2027	27,939	30,262,508	0.1
Univision Communications, Inc.	9.50%	05/01/2025	5,276	5,752,944	0.0
Virgin Media Secured Finance PLC	4.50%	08/15/2030	2,446	2,481,493	0.0
Ziggo Bond Co. BV	5.13%	02/28/2030	2,294	2,356,746	0.0
Ziggo BV	4.88%	01/15/2030	18,189	18,618,572	0.1
Ziggo BV	5.50%	01/15/2027	7,322	7,592,466	0.0
				<u>584,110,294</u>	<u>2.4</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France SA/France	8.13%	02/01/2027	974	1,056,860	0.0
Connect Finco SARM/Connect US Finco LLC	6.75%	10/01/2026	40,042	41,543,575	0.2
Consolidated Communications, Inc.	5.00%	10/01/2028	7,395	7,633,190	0.0
Consolidated Communications, Inc.	6.50%	10/01/2028	32,651	35,710,275	0.1
Embarq Corp.	8.00%	06/01/2036	24,271	25,583,896	0.1
Lumen Technologies, Inc., Series Y.	7.50%	04/01/2024	17,638	19,646,556	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.20%	07/18/2036	9,850	12,381,308	0.1
Telecom Italia Capital SA	7.72%	06/04/2038	8,678	11,282,814	0.0
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.75%	07/15/2031	6,675	6,857,903	0.0
				<u>161,696,377</u>	<u>0.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient US LLC	9.00%	04/15/2025	24,423	26,609,861	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.25%	04/01/2025	3,071	3,173,076	0.0
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.50%	04/01/2027	20,726	21,780,761	0.1
American Axle & Manufacturing, Inc.	6.88%	07/01/2028	10,159	10,971,667	0.0
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	6.25%	05/15/2026	22,680	23,939,484	0.1
Dana, Inc.	4.25%	09/01/2030	13,200	13,717,826	0.1
Dana, Inc.	5.38%	11/15/2027	13,089	13,828,331	0.1
Dana, Inc.	5.63%	06/15/2028	4,704	5,059,022	0.0
Ford Motor Co.	6.63%	10/01/2028	3,800	4,549,035	0.0
Ford Motor Co.	8.50%	04/21/2023	74,190	82,089,647	0.3
Ford Motor Co.	9.00%	04/22/2025	20,702	25,226,241	0.1
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.00%	07/15/2029	8,698	9,205,758	0.0
Goodyear Tire & Rubber Co. (The)	5.25%	07/15/2031	7,360	7,875,014	0.0
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.00%	05/15/2027	23,494	24,595,061	0.1
IHO Verwaltungs GmbH(b)	6.38%	05/15/2029	12,577	13,696,287	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.50%	07/15/2029	22,261	21,958,015	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	01/15/2028	31,879	32,888,097	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	7.75%	10/15/2025	34,461	37,669,537	0.2
Meritor, Inc.	6.25%	06/01/2025	10,388	11,046,674	0.1
Tenneco, Inc.	7.88%	01/15/2029	8,241	9,300,245	0.0
ZF North America Capital, Inc.	4.75%	04/29/2025	17,495	19,114,043	0.1
				<u>418,293,682</u>	<u>1.7</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	5.75%	03/01/2027	24,848	25,344,960	0.1
Carnival Corp.	11.50%	04/01/2023	59,923	67,390,107	0.3
Cedar Fair LP/Canada's Wonderland Co./ Magnum Management Corp./Millennium Op.	5.50%	05/01/2025	54,796	57,027,750	0.2
Mattel, Inc.	5.88%	12/15/2027	2,131	2,327,755	0.0
National CineMedia LLC	5.75%	08/15/2026	8,693	6,524,845	0.0
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	08/31/2026	23,060	23,377,075	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	5.50%	04/01/2028	15,887	15,966,435	0.1
Royal Caribbean Cruises Ltd.	10.88%	06/01/2023	31,966	35,895,181	0.2
Royal Caribbean Cruises Ltd.	11.50%	06/01/2025	34,310	39,413,612	0.2
Six Flags Theme Parks, Inc.	7.00%	07/01/2025	10,297	11,015,309	0.0
Vail Resorts, Inc.	6.25%	05/15/2025	8,044	8,565,301	0.0
Viking Ocean Cruises Ship VII Ltd.	5.63%	02/15/2029	8,267	8,252,336	0.0
VOC Escrow Ltd.	5.00%	02/15/2028	23,181	22,913,770	0.1
				<u>324,014,436</u>	<u>1.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Adams Homes, Inc.	7.50%	02/15/2025	14,225	14,913,944	0.1
Beazer Homes USA, Inc.	6.75%	03/15/2025	500	516,541	0.0
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	4.88%	02/15/2030	28,915	29,155,124	0.1
Brookfield Residential Properties, Inc./ Brookfield Residential US LLC	6.25%	09/15/2027	49,014	51,751,113	0.2
Caesars Entertainment, Inc.	6.25%	07/01/2025	30,496	32,225,162	0.1
Empire Communities Corp.	7.00%	12/15/2025	8,518	9,006,084	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Forterra Finance LLC/FRTA Finance Corp.	6.50%	07/15/2025	USD 8,322	\$ 8,926,383	0.0%
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.38%	05/01/2025	5,635	5,912,416	0.0
Hilton Domestic Operating Co., Inc.	5.75%	05/01/2028	6,163	6,661,260	0.0
Installed Building Products, Inc.	5.75%	02/01/2028	5,196	5,477,478	0.0
International Game Technology PLC	5.25%	01/15/2029	11,337	12,123,989	0.1
International Game Technology PLC	6.25%	01/15/2027	37,757	43,048,453	0.2
KB Home	4.80%	11/15/2029	7,465	8,288,520	0.0
KB Home	6.88%	06/15/2027	7,102	8,516,449	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	4.75%	01/15/2028	10,000	10,168,470	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc.	6.13%	09/15/2025	6,068	6,389,934	0.0
Marriott Ownership Resorts, Inc./ILG LLC	6.50%	09/15/2026	12,634	13,060,699	0.1
Mattamy Group Corp.	4.63%	03/01/2030	9,000	9,227,513	0.0
Meritage Homes Corp.	5.13%	06/06/2027	1,000	1,131,066	0.0
Shea Homes LP/Shea Homes Funding Corp.	4.75%	02/15/2028	19,163	19,753,925	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.75%	01/15/2028	9,959	11,226,031	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc.	5.88%	06/15/2027	17,629	20,050,456	0.1
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.63%	03/01/2024	338	363,678	0.0
Taylor Morrison Communities, Inc./ Taylor Morrison Holdings II, Inc.	5.88%	04/15/2023	21,565	22,643,250	0.1
Travel Plus Leisure Co.	6.63%	07/31/2026	13,210	15,050,490	0.1
Wynn Las Vegas LLC/Wynn Las Vegas Capital Corp.	5.50%	03/01/2025	13,291	14,104,484	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	5.13%	10/01/2029	13,465	14,036,345	0.1
Wynn Resorts Finance LLC/Wynn Resorts Capital Corp.	7.75%	04/15/2025	14,262	15,155,567	0.1
				<u>408,884,824</u>	<u>1.6</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
Yum! Brands, Inc.	4.75%	01/15/2030	67	73,895	0.0
Yum! Brands, Inc.	7.75%	04/01/2025	11,003	11,853,059	0.0
				<u>11,926,954</u>	<u>0.0</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Bath & Body Works, Inc.	5.25%	02/01/2028	5,737	6,426,963	0.0
Bath & Body Works, Inc.	6.63%	10/01/2030	6,017	6,981,846	0.0
Bath & Body Works, Inc.	6.75%	07/01/2036	25,820	32,905,535	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.88%	11/01/2035	21,725	27,909,527	0.1
Bath & Body Works, Inc.	6.95%	03/01/2033	329	397,429	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.50%	06/15/2029	7,154	8,306,349	0.0
Bath & Body Works, Inc.	7.60%	07/15/2037	716	902,558	0.0
FirstCash, Inc.	4.63%	09/01/2028	767	798,723	0.0
Michaels Cos, Inc. (The)	5.25%	05/01/2028	25,046	25,700,052	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	4.75%	09/15/2029	11,452	12,145,589	0.1
Murphy Oil USA, Inc.	5.63%	05/01/2027	661	695,318	0.0
PetSmart, Inc./PetSmart Finance Corp.	4.75%	02/15/2028	39,680	41,308,961	0.2
Specialty Building Products Holdings LLC/SBP Finance Corp.	6.38%	09/30/2026	20,356	21,434,584	0.1
Staples, Inc.	7.50%	04/15/2026	24,937	25,262,335	0.1
William Carter Co. (The)	5.50%	05/15/2025	10,330	10,850,216	0.1
				<u>222,025,985</u>	<u>0.9</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
AdaptHealth LLC.	6.13%	08/01/2028	7,613	8,144,845	0.0
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC.	4.88%	02/15/2030	17,673	19,300,981	0.1
Albertsons Cos., Inc./Safeway, Inc./ New Albertsons LP/Albertsons LLC.	5.75%	03/15/2025	2,786	2,847,681	0.0
Bausch Health Americas, Inc.	8.50%	01/31/2027	5,505	5,919,392	0.0
Bausch Health Cos., Inc.	6.25%	02/15/2029	17,487	17,357,718	0.1
Bausch Health Cos., Inc.	9.00%	12/15/2025	271	288,747	0.0
CD&R Smokey Buyer, Inc.	6.75%	07/15/2025	1,977	2,102,833	0.0
Emergent BioSolutions, Inc.	3.88%	08/15/2028	1,537	1,504,728	0.0
Endo Luxembourg Finance Co. I SARL/Endo US, Inc.	6.13%	04/01/2029	11,048	10,869,170	0.1
Jazz Securities DAC	4.38%	01/15/2029	19,855	20,620,629	0.1
Kronos Acquisition Holdings, Inc./KIK Custom Products, Inc.	5.00%	12/31/2026	33,210	33,075,158	0.1
Legacy LifePoint Health LLC	6.75%	04/15/2025	64,710	68,306,442	0.3
MEDNAX, Inc.	6.25%	01/15/2027	16,419	17,306,857	0.1
ModivCare Escrow Issuer, Inc.	5.00%	10/01/2029	4,663	4,792,655	0.0
ModivCare, Inc.	5.88%	11/15/2025	5,134	5,469,382	0.0
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV.	5.13%	04/30/2031	17,094	17,929,243	0.1
Par Pharmaceutical, Inc.	7.50%	04/01/2027	16,641	16,857,017	0.1
Post Holdings, Inc.	4.50%	09/15/2031	10,368	10,478,318	0.0
Post Holdings, Inc.	5.50%	12/15/2029	6,547	7,015,765	0.0
Post Holdings, Inc.	5.63%	01/15/2028	7,135	7,510,033	0.0
RP Escrow Issuer LLC.	5.25%	12/15/2025	24,848	25,409,987	0.1
Tenet Healthcare Corp.	4.88%	01/01/2026	87	90,174	0.0
Tenet Healthcare Corp.	7.50%	04/01/2025	20,067	21,501,201	0.1
US Acute Care Solutions LLC.	6.38%	03/01/2026	9,491	9,880,444	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
WASH Multifamily Acquisition, Inc.	5.75%	04/15/2026	USD 10,206	\$ 10,675,539	0.1%
				345,254,939	1.4
ENERGIE					
Berry Petroleum Co. LLC	7.00%	02/15/2026	6,480	6,422,829	0.0
Blue Racer Midstream LLC/Blue Racer Finance Corp.	7.63%	12/15/2025	12,558	13,632,628	0.1
Cheniere Energy Partners LP	4.50%	10/01/2029	4,266	4,597,115	0.0
Cheniere Energy Partners LP	5.63%	10/01/2026	15,850	16,402,491	0.1
CITGO Petroleum Corp.	6.38%	06/15/2026	13,237	13,457,157	0.1
CITGO Petroleum Corp.	7.00%	06/15/2025	45,862	46,959,878	0.2
CNX Resources Corp.	6.00%	01/15/2029	20,821	21,673,334	0.1
Comstock Resources, Inc.	5.88%	01/15/2030	9,957	9,970,294	0.0
CQP Holdco LP/BIP-V Chinook Holdco LLC	5.50%	06/15/2031	25,000	25,796,191	0.1
Encino Acquisition Partners Holdings LLC	8.50%	05/01/2028	16,698	16,744,397	0.1
EnLink Midstream LLC	5.63%	01/15/2028	31,228	32,760,349	0.1
EnLink Midstream Partners LP	4.40%	04/01/2024	804	836,214	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.05%	04/01/2045	14,978	13,737,450	0.1
EnLink Midstream Partners LP	5.45%	06/01/2047	10,303	9,776,721	0.0
EnLink Midstream Partners LP	5.60%	04/01/2044	1,916	1,838,135	0.0
EQM Midstream Partners LP	4.50%	01/15/2029	19,253	19,577,527	0.1
EQM Midstream Partners LP	4.75%	01/15/2031	18,247	18,564,495	0.1
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.....	6.25%	05/15/2026	5,083	4,917,125	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.....	6.50%	10/01/2025	3,830	3,762,186	0.0
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.....	7.75%	02/01/2028	40,175	39,348,578	0.2
Genesis Energy LP/Genesis Energy Finance Corp.....	8.00%	01/15/2027	32,532	32,334,033	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.....	6.88%	01/15/2029	11,607	12,039,034	0.1
Global Partners LP/GLP Finance Corp.....	7.00%	08/01/2027	9,655	10,038,255	0.0
Hess Midstream Operations LP	4.25%	02/15/2030	3,991	4,042,421	0.0
Hess Midstream Operations LP	5.63%	02/15/2026	8,201	8,528,208	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.....	5.75%	02/01/2029	10,533	10,689,566	0.0
Hilcorp Energy I LP/Hilcorp Finance Co.....	6.00%	02/01/2031	10,533	10,816,605	0.0
Independence Energy Finance LLC	7.25%	05/01/2026	27,560	27,843,257	0.1
Indigo Natural Resources LLC	5.38%	02/01/2029	9,767	10,080,982	0.0
Ithaca Energy North Sea PLC	9.00%	07/15/2026	9,052	8,987,466	0.0
ITT Holdings LLC	6.50%	08/01/2029	42,132	42,992,846	0.2
Nabors Industries Ltd.	7.25%	01/15/2026	12,604	11,746,018	0.1
Nabors Industries Ltd.	7.50%	01/15/2028	12,402	11,282,183	0.1
Neptune Energy Bondco PLC	6.63%	05/15/2025	3,286	3,336,360	0.0
New Fortress Energy, Inc.	6.75%	09/15/2025	37,249	37,797,345	0.2
NGL Energy Operating LLC/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	02/01/2026	71,875	72,911,487	0.3
NGL Energy Partners LP/NGL Energy Finance Corp.	7.50%	11/01/2023	2,382	2,244,624	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	2.70%	02/15/2023	6,792	6,913,107	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	2.90%	08/15/2024	13,626	13,974,790	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	3.40%	04/15/2026	3,253	3,361,206	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	3.50%	06/15/2025	17,408	18,264,214	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	5.50%	12/01/2025	1,231	1,372,565	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	5.88%	09/01/2025	6,779	7,624,362	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	6.13%	01/01/2031	9,758	11,797,489	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	8.00%	07/15/2025	10,610	12,782,189	0.1
Occidental Petroleum Corp.....	8.50%	07/15/2027	6,994	8,819,302	0.0
Occidental Petroleum Corp.....	8.88%	07/15/2030	6,994	9,595,295	0.0
PBF Holding Co. LLC/PBF Finance Corp.....	9.25%	05/15/2025	26,889	25,950,297	0.1
PDC Energy, Inc.	5.75%	05/15/2026	11,395	11,839,325	0.1
PDC Energy, Inc.	6.13%	09/15/2024	6,833	6,948,534	0.0
Range Resources Corp.	5.00%	03/15/2023	1,794	1,843,339	0.0
Renewable Energy Group, Inc.	5.88%	06/01/2028	5,372	5,563,802	0.0
SM Energy Co.....	10.00%	01/15/2025	24,179	26,931,839	0.1
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.....	5.88%	03/15/2028	5,701	6,017,302	0.0
Sunoco LP/Sunoco Finance Corp.....	6.00%	04/15/2027	3,165	3,305,886	0.0
Targa Resources Partners LP/ Targa Resources Partners Finance Corp.....	6.50%	07/15/2027	16,917	18,286,066	0.1
Transocean Phoenix 2 Ltd.....	7.75%	10/15/2024	5,664	5,759,393	0.0
Transocean Poseidon Ltd.	6.88%	02/01/2027	8,159	7,879,342	0.0
Transocean Sentry Ltd.	5.38%	05/15/2023	23,117	22,161,641	0.1
Western Midstream Operating LP	3.95%	06/01/2025	24,604	25,851,378	0.1
Western Midstream Operating LP	4.50%	03/01/2028	4,159	4,477,310	0.0
Western Midstream Operating LP	4.65%	07/01/2026	12,047	12,955,355	0.1
Western Midstream Operating LP	4.75%	08/15/2028	7,998	8,772,371	0.0
				927,533,483	3.7
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Avient Corp.....	5.75%	05/15/2025	8,238	8,692,179	0.1
Interface, Inc.....	5.50%	12/01/2028	6,810	7,142,065	0.0
				15,834,244	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
DIENSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp.	6.63%	07/15/2026	USD 41,102	\$ 43,917,349	0.2%
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./Atlas Luxco 4 SARL	4.63%	06/01/2028	23,890	23,960,555	0.1
APX Group, Inc.	6.75%	02/15/2027	14,450	15,480,805	0.1
Aramark Services, Inc.	5.00%	02/01/2028	750	780,357	0.0
Aramark Services, Inc.	6.38%	05/01/2025	16,856	17,825,244	0.1
Cars.com, Inc.	6.38%	11/01/2028	14,634	15,595,546	0.1
Gartner, Inc.	4.50%	07/01/2028	768	814,700	0.0
ION Trading Technologies SARL	5.75%	05/15/2028	11,107	11,462,534	0.0
Millennium Escrow Corp.	6.63%	08/01/2026	24,610	25,254,673	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.50%	09/01/2028	26,526	26,951,719	0.1
MPH Acquisition Holdings LLC	5.75%	11/01/2028	34,084	32,551,855	0.1
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.63%	10/01/2028	10,002	10,530,059	0.0
Nielsen Finance LLC/Nielsen Finance Co.	5.88%	10/01/2030	5,599	5,983,704	0.0
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.25%	04/15/2024	11,896	12,648,797	0.1
Prime Security Services Borrower LLC/Prime Finance, Inc.	5.75%	04/15/2026	12,000	12,990,954	0.1
Ritchie Bros Auctioneers, Inc.	5.38%	01/15/2025	1,575	1,616,648	0.0
Sabre GBLB, Inc.	7.38%	09/01/2025	2,660	2,820,277	0.0
Sabre GBLB, Inc.	9.25%	04/15/2025	17,308	19,948,630	0.1
TripAdvisor, Inc.	7.00%	07/15/2025	10,576	11,186,035	0.0
				292,320,441	1.2
TECHNOLOGIE					
Avaya, Inc.	6.13%	09/15/2028	40,340	42,570,236	0.2
Boxer Parent Co., Inc.	7.13%	10/02/2025	9,123	9,763,331	0.1
CommScope, Inc.	6.00%	03/01/2026	2,210	2,316,569	0.0
Dell International LLC/EMC Corp.	5.85%	07/15/2025	6,238	7,287,689	0.0
LogMeIn, Inc.	5.50%	09/01/2027	3,670	3,815,291	0.0
NCR Corp.	5.75%	09/01/2027	10,151	10,765,921	0.1
NCR Corp.	6.13%	09/01/2029	7,437	8,095,937	0.0
Science Applications International Corp.	4.88%	04/01/2028	1,671	1,744,345	0.0
Seagate HDD Cayman	4.09%	06/01/2029	8,300	8,787,722	0.0
Veritas US, Inc./Veritas Bermuda Ltd.	7.50%	09/01/2025	76,800	79,813,117	0.3
				174,960,158	0.7
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Air Canada	3.88%	08/15/2026	4,966	4,993,303	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.50%	04/20/2026	10,093	10,616,961	0.0
American Airlines, Inc./AAAdvantage Loyalty IP Ltd.	5.75%	04/20/2029	17,711	19,054,322	0.1
Hawaiian Brand Intellectual Property Ltd./HawaiianMiles Loyalty Ltd.	5.75%	01/20/2026	14,186	14,937,926	0.1
Spirit Loyalty Cayman Ltd./Spirit IP Cayman Ltd.	8.00%	09/20/2025	31,569	35,876,911	0.1
				85,479,423	0.3
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Avis Budget Car Rental LLC/Avis Budget Finance, Inc.	5.38%	03/01/2029	9,641	10,120,570	0.0
Herc Holdings, Inc.	5.50%	07/15/2027	12,745	13,431,840	0.1
Modulaire Global Finance PLC	8.00%	02/15/2023	21,470	22,044,321	0.1
United Rentals North America, Inc.	4.88%	01/15/2028	293	310,469	0.0
				45,907,200	0.2
				4,361,105,733	17.5
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Alliance Data Systems Corp.	4.75%	12/15/2024	33,539	34,371,822	0.1
Alliance Data Systems Corp.	7.00%	01/15/2026	15,902	17,054,895	0.1
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA, Series 9(c)	6.50%	03/05/2025	48,200	52,690,529	0.2
Banco Santander SA(c)	7.50%	02/08/2024	20,400	22,320,756	0.1
Credit Suisse Group AG(c)	6.25%	12/18/2024	45,694	49,675,436	0.3
Credit Suisse Group AG(c)	7.50%	07/17/2023	32,959	35,537,448	0.1
Credit Suisse Group AG(c)	7.50%	12/11/2023	27,004	29,772,362	0.1
Dresdner Funding Trust I	8.15%	06/30/2031	11,620	16,834,962	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	5.02%	06/26/2024	29,505	32,000,371	0.1
Intesa Sanpaolo SpA	5.71%	01/15/2026	3,000	3,373,943	0.0
Societe Generale SA(c)	7.88%	12/18/2023	9,332	10,370,185	0.0
Societe Generale SA(c)	8.00%	09/29/2025	16,232	19,186,407	0.1
				323,189,116	1.3
FINANZEN					
Aircastle Ltd.(c)	5.25%	06/15/2026	15,194	15,276,873	0.0
goeasy Ltd.	5.38%	12/01/2024	21,183	21,859,696	0.1
Jefferies Finance LLC/JFIN Co-Issuer Corp.	5.00%	08/15/2028	15,619	16,007,259	0.1
Navient Corp.	6.50%	06/15/2022	16,842	17,525,025	0.1
				70,668,853	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
REITs					
Brookfield Property REIT, Inc./BPR Cumulus LLC/ BPR Nimbus LLC/GGSI Sellco LL	5.75%	05/15/2026	USD 38,844	\$ 40,147,898	0.1%
Diversified Healthcare Trust	9.75%	06/15/2025	27,934	30,822,865	0.1
Iron Mountain, Inc.	4.88%	09/15/2029	15,460	16,310,248	0.1
Iron Mountain, Inc.	5.00%	07/15/2028	10,020	10,491,794	0.0
Iron Mountain, Inc.	5.25%	03/15/2028	13,339	14,047,762	0.1
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.63%	05/01/2024	1,235	1,348,136	0.0
MGM Growth Properties Operating Partnership LP/ MGP Finance Co-Issuer, Inc.	5.75%	02/01/2027	19,477	22,434,007	0.1
Park Intermediate Holdings LLC/PK Domestic Property LLC/ PK Finance Co-Issuer	4.88%	05/15/2029	13,793	14,202,661	0.1
				<u>149,805,371</u>	<u>0.6</u>
				<u>543,663,340</u>	<u>2.2</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Calpine Corp.	5.13%	03/15/2028	25,246	25,748,789	0.1
Talen Energy Supply LLC	6.50%	06/01/2025	2,406	1,047,471	0.0
Talen Energy Supply LLC	7.25%	05/15/2027	62,448	54,017,685	0.2
Terraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	7,871	8,100,753	0.1
Vistra Operations Co. LLC	5.63%	02/15/2027	22,023	22,929,910	0.1
				<u>111,844,608</u>	<u>0.5</u>
SONSTIGE VERSORGUNGSBETRIEBE					
Solaris Midstream Holdings LLC	7.63%	04/01/2026	8,545	9,059,618	0.0
				<u>120,904,226</u>	<u>0.5</u>
				<u>5,025,673,299</u>	<u>20.2</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	4.80%	04/18/2026	7,000	7,953,786	0.0
AIB Group PLC	4.26%	04/10/2025	60,316	64,825,647	0.2
Ally Financial, Inc.	5.80%	05/01/2025	8,159	9,441,098	0.0
Ally Financial, Inc.	8.00%	11/01/2031	11,107	15,953,577	0.1
American Express Co., Series C(c) (d)	3.40%	09/15/2021	2,849	2,850,425	0.0
AmSouth Bancorp	6.75%	11/01/2025	11,929	14,420,928	0.1
Australia & New Zealand Banking Group Ltd.	4.40%	05/19/2026	8,780	9,921,103	0.0
Australia & New Zealand Banking Group Ltd./United Kingdom(c)	6.75%	06/15/2026	43,923	51,563,907	0.2
Banco Santander SA	5.18%	11/19/2025	74,800	85,407,784	0.3
Bank of America Corp., Series X(c)	6.25%	09/05/2024	15,203	16,840,087	0.1
Bank of America Corp., Series Z(c)	6.50%	10/23/2024	14,620	16,500,156	0.1
Bank of America Corp., Series B	8.05%	06/15/2027	34,006	43,681,799	0.2
Bank of Ireland Group PLC	4.50%	11/25/2023	17,000	18,309,957	0.1
Bank of New York Mellon Corp. (The), Series E(c) (d)	3.55%	12/20/2021	3,374	3,394,543	0.0
Barclays Bank PLC	7.63%	11/21/2022	8,608	9,309,511	0.0
BBVA USA	5.90%	04/01/2026	7,500	8,809,502	0.0
BNP Paribas SA	4.63%	03/13/2027	13,920	15,736,135	0.1
BNP Paribas SA(c)	6.75%	03/14/2022	25,631	26,309,417	0.1
BPCE SA	4.63%	07/11/2024	17,050	18,644,910	0.1
BPCE SA	5.15%	07/21/2024	23,413	25,988,660	0.1
Capital One Financial Corp.	3.75%	03/09/2027	16,128	18,040,414	0.1
Capital One Financial Corp., Series E(c) (d)	3.93%	09/01/2021	14,146	14,146,000	0.1
CIT Bank NA	2.97%	09/27/2025	2,736	2,887,211	0.0
Citigroup, Inc.(c)	3.88%	02/18/2026	24,915	25,631,306	0.1
Citigroup, Inc., Series W(c)	4.00%	12/10/2025	16,145	16,779,719	0.1
Citigroup, Inc., Series V(c)	4.70%	01/30/2025	9,977	10,413,196	0.0
Citigroup, Inc., Series U(c)	5.00%	09/12/2024	26,500	27,903,386	0.1
Citigroup, Inc.	5.50%	09/13/2025	10,703	12,435,355	0.1
Citigroup, Inc.(c)	5.95%	01/30/2023	14,902	15,653,897	0.1
Citigroup, Inc., Series P(c)	5.95%	05/15/2025	10,465	11,452,204	0.0
Commerzbank AG	8.13%	09/19/2023	12,284	13,878,804	0.0
Coöperatieve Rabobank UA	3.75%	07/21/2026	23,078	25,534,058	0.1
Credit Agricole SA	4.38%	03/17/2025	4,798	5,272,876	0.0
Credit Agricole SA(c)	8.13%	12/23/2025	41,187	50,150,637	0.2
Discover Bank	3.45%	07/27/2026	10,000	10,913,839	0.0
Discover Bank	4.68%	08/09/2028	42,248	44,864,903	0.2
DNB Bank ASA(c)	6.50%	03/26/2022	63,959	65,863,680	0.3
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series P(c)	5.00%	11/10/2022	15,687	15,855,288	0.1
Goldman Sachs Group, Inc. (The), Series O(c)	5.30%	11/10/2026	1,910	2,124,608	0.0
HSBC Holdings PLC(c)	6.38%	03/30/2025	10,483	11,596,819	0.0
HSBC Holdings PLC(c)	6.50%	03/23/2028	17,335	19,740,411	0.1
ING Groep NV(c)	6.75%	04/16/2024	31,733	34,756,784	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
ING Groep NV(c)	6.88%	04/16/2022	USD 3,000	\$ 3,095,884	0.0%
JPMorgan Chase & Co., Series S(c)	6.75%	02/01/2024	13,340	14,724,025	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.50%	11/04/2024	14,820	16,346,853	0.1
Lloyds Banking Group PLC	4.58%	12/10/2025	22,665	25,525,462	0.1
Lloyds Banking Group PLC(c)	7.50%	06/27/2024	25,585	28,660,088	0.1
Mizuho Financial Group Cayman 3 Ltd.	4.60%	03/27/2024	22,608	24,594,912	0.1
Natwest Group PLC, Series U(c) (d)	2.47%	09/30/2027	15,700	15,643,116	0.1
Nordea Bank Abp(c)	6.63%	03/26/2026	59,046	68,144,317	0.3
Santander Holdings USA, Inc.	4.40%	07/13/2027	51,158	57,719,309	0.2
Societe Generale SA	4.25%	04/14/2025	11,148	12,111,524	0.0
Societe Generale SA	4.25%	08/19/2026	17,260	18,980,152	0.1
Societe Generale SA	4.75%	11/24/2025	22,112	24,654,808	0.1
Standard Chartered PLC(c) (d)	1.64%	01/30/2027	34,013	33,001,582	0.2
Standard Chartered PLC	4.30%	02/19/2027	1,500	1,649,467	0.0
Standard Chartered PLC	5.20%	01/26/2024	4,628	5,047,653	0.0
Standard Chartered PLC	5.70%	01/25/2022	9,510	9,694,978	0.0
Standard Chartered PLC(c)	7.75%	04/02/2023	3,200	3,476,514	0.0
Svenska Handelsbanken AB(c)	4.75%	03/01/2031	13,600	14,593,523	0.1
Swedbank AB, Series NC5(c)	5.63%	09/17/2024	13,600	14,791,534	0.1
Swedbank AB(c)	6.00%	03/17/2022	5,200	5,324,485	0.0
UBS AG	5.13%	05/15/2024	7,742	8,505,813	0.0
UBS AG/Stamford CT	7.63%	08/17/2022	14,464	15,407,119	0.1
UBS Group AG(c)	7.00%	01/31/2024	12,992	14,274,960	0.1
UBS Group AG(c)	7.00%	02/19/2025	28,847	33,136,412	0.1
UniCredit SpA	4.63%	04/12/2027	1,425	1,605,250	0.0
UniCredit SpA	6.57%	01/14/2022	82,677	84,440,667	0.3
UniCredit SpA	7.83%	12/04/2023	24,650	28,245,763	0.1
Wells Fargo & Co., Series U(c)	5.88%	06/15/2025	13,500	15,210,733	0.1
				<u>1,520,365,230</u>	<u>6.1</u>
MAKLER					
Charles Schwab Corp. (The), Series G(c)	5.38%	06/01/2025	41,119	45,790,771	0.2
FINANZEN					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	2.88%	08/14/2024	3,072	3,203,650	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.30%	01/23/2023	162	167,276	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	3.88%	01/23/2028	7,258	7,785,509	0.0
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	4.45%	10/01/2025	12,253	13,433,883	0.1
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap Global Aviation Trust	6.50%	07/15/2025	3,140	3,667,940	0.0
Aircastle Ltd.	2.85%	01/26/2028	8,142	8,328,709	0.0
Aircastle Ltd.	4.13%	05/01/2024	4,820	5,137,666	0.0
Aircastle Ltd.	4.25%	06/15/2026	1,132	1,244,840	0.0
Aircastle Ltd.	4.40%	09/25/2023	12,230	13,046,432	0.1
Aircastle Ltd.	5.00%	04/01/2023	996	1,060,089	0.0
Aircastle Ltd.	5.25%	08/11/2025	46,031	51,657,269	0.2
Aviation Capital Group LLC	1.95%	01/30/2026	2,054	2,065,824	0.0
Aviation Capital Group LLC	2.88%	01/20/2022	2,000	2,013,254	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.50%	11/01/2027	8,286	8,785,394	0.0
Aviation Capital Group LLC	3.88%	05/01/2023	14,972	15,659,436	0.1
Aviation Capital Group LLC	4.13%	08/01/2025	117	126,779	0.0
Aviation Capital Group LLC	4.38%	01/30/2024	35,753	38,321,392	0.2
Aviation Capital Group LLC	4.88%	10/01/2025	4,985	5,545,550	0.0
Aviation Capital Group LLC	5.50%	12/15/2024	30,672	34,581,669	0.2
GE Capital Funding LLC	4.40%	05/15/2030	26,675	31,281,103	0.1
Synchrony Financial	3.95%	12/01/2027	18,633	20,797,001	0.1
Synchrony Financial	4.50%	07/23/2025	6,395	7,117,984	0.0
Synchrony Financial	5.15%	03/19/2029	1,500	1,781,482	0.0
				<u>276,810,131</u>	<u>1.1</u>
VERSICHERUNGEN					
ACE Capital Trust II	9.70%	04/01/2030	27,094	40,916,394	0.2
Allstate Corp. (The), Series B	5.75%	08/15/2053	35,856	38,884,955	0.2
Allstate Corp. (The)	6.50%	05/15/2057	8,665	11,632,472	0.0
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.63%	08/15/2052	21,351	24,660,405	0.1
Argentum Netherlands BV for Swiss Re Ltd.	5.75%	08/15/2050	18,619	21,191,653	0.1
Cloverie PLC for Zurich Insurance Co., Ltd.	5.63%	06/24/2046	3,300	3,842,784	0.0
Hartford Financial Services Group, Inc. (The), Series ICON(d)	2.25%	02/12/2047	61,341	58,969,112	0.2
Liberty Mutual Group, Inc.	7.80%	03/15/2037	7,135	9,578,504	0.0
MetLife Capital Trust IV	7.88%	12/15/2037	11,997	16,730,502	0.1
MetLife, Inc.	6.40%	12/15/2036	7,456	9,547,015	0.0
MetLife, Inc.	10.75%	08/01/2039	8,590	15,240,372	0.1
Prudential Financial, Inc.	5.20%	03/15/2044	42,601	45,934,887	0.2
Prudential Financial, Inc.	5.63%	06/15/2043	47,823	51,099,862	0.2
Prudential Financial, Inc.	5.88%	09/15/2042	5,247	5,503,774	0.0
Swiss Re Finance Luxembourg SA	5.00%	04/02/2049	15,690	18,043,500	0.1
Voya Financial, Inc.	5.65%	05/15/2053	68,904	72,866,374	0.3
				<u>444,642,565</u>	<u>1.8</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SONSTIGE FINANZWERTE					
AerCap Ireland Capital DAC/AerCap					
Global Aviation Trust	4.45%	04/03/2026	USD 6,125	\$ 6,717,310	0.0%
REITs					
Brixmor Operating Partnership LP	4.05%	07/01/2030	13,285	15,039,401	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.25%	06/01/2025	14,960	16,787,331	0.1
GLP Capital LP/GLP Financing II, Inc.	5.38%	04/15/2026	5,190	5,950,316	0.0
Kite Realty Group LP	4.00%	10/01/2026	2,785	3,014,215	0.0
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	4.63%	08/01/2029	14,064	15,049,814	0.1
MPT Operating Partnership LP/MPT Finance Corp.	5.25%	08/01/2026	15,081	15,574,749	0.1
Omega Healthcare Investors, Inc.	4.50%	01/15/2025	3,865	4,244,476	0.0
Omega Healthcare Investors, Inc.	5.25%	01/15/2026	5,503	6,282,272	0.0
Regency Centers LP	3.60%	02/01/2027	7,680	8,509,798	0.0
Sabra Health Care LP	4.80%	06/01/2024	27,053	29,553,688	0.1
SITE Centers Corp.	3.63%	02/01/2025	13,265	14,061,924	0.1
SITE Centers Corp.	4.70%	06/01/2027	18,600	20,944,399	0.1
Spirit Realty LP	4.00%	07/15/2029	14,882	16,739,574	0.1
Spirit Realty LP	4.45%	09/15/2026	27,056	30,446,774	0.1
STORE Capital Corp.	4.63%	03/15/2029	4,573	5,266,647	0.0
Susa Partnership LP	7.50%	12/01/2027	6,000	7,656,221	0.0
VEREIT Operating Partnership LP	3.40%	01/15/2028	7,691	8,399,390	0.0
				<u>223,520,989</u>	<u>0.9</u>
				<u>2,517,846,996</u>	<u>10.1</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Arconic Corp.	6.00%	05/15/2025	29,005	30,675,794	0.1
CF Industries, Inc.	4.95%	06/01/2043	5,949	7,337,630	0.1
CF Industries, Inc.	5.15%	03/15/2034	367	458,423	0.0
CF Industries, Inc.	5.38%	03/15/2044	14,821	19,263,517	0.1
Huntsman International LLC	4.50%	05/01/2029	13,936	15,979,140	0.1
MEGlobal Canada ULC	5.00%	05/18/2025	5,875	6,562,820	0.0
MEGlobal Canada ULC	5.88%	05/18/2030	3,112	3,878,406	0.0
Rohm & Haas Co.	7.85%	07/15/2029	22,000	30,817,638	0.1
				<u>114,973,368</u>	<u>0.5</u>
INVESTITIONSGÜTER					
General Electric Co., Series D(c) (d)	3.45%	12/15/2021	41,196	40,025,576	0.1
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	3.20%	06/15/2025	1,975	2,105,196	0.0
Westinghouse Air Brake Technologies Corp.	4.40%	03/15/2024	12,188	13,145,463	0.1
				<u>55,276,235</u>	<u>0.2</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Omnicom Group, Inc.	4.20%	06/01/2030	7,263	8,407,691	0.0
Time Warner Entertainment Co. LP	8.38%	07/15/2033	15,020	22,425,938	0.1
				<u>30,833,629</u>	<u>0.1</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	6.45%	06/15/2034	10,741	14,386,097	0.1
AT&T, Inc.	7.13%	12/15/2031	3,042	4,182,345	0.0
AT&T, Inc.	7.63%	04/15/2031	5,000	6,990,900	0.0
British Telecommunications PLC	5.13%	12/04/2028	18,590	22,013,834	0.1
British Telecommunications PLC	9.63%	12/15/2030	14,260	22,016,114	0.1
Qwest Corp.	6.75%	12/01/2021	2,000	2,028,051	0.0
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	4.74%	03/20/2025	13,355	14,242,237	0.1
Sprint Spectrum Co. LLC/Sprint Spectrum Co. II LLC/ Sprint Spectrum Co. III LLC	5.15%	03/20/2028	9,140	10,527,004	0.0
				<u>96,386,582</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
General Motors Co.	6.13%	10/01/2025	3,702	4,369,347	0.0
General Motors Co.	6.25%	10/02/2043	7,450	10,195,230	0.0
General Motors Co.	6.80%	10/01/2027	5,262	6,628,062	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	4.00%	10/06/2026	5,490	6,071,612	0.0
General Motors Financial Co., Inc.	5.25%	03/01/2026	20,949	24,111,877	0.1
Harley-Davidson Financial Services, Inc.	3.35%	06/08/2025	27,028	28,764,073	0.1
Lear Corp.	3.50%	05/30/2030	10,754	11,660,792	0.1
Lear Corp.	3.80%	09/15/2027	16,668	18,548,786	0.1
Nissan Motor Co., Ltd.	4.35%	09/17/2027	20,699	22,993,957	0.1
				<u>133,343,736</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Genting New York LLC/GENNY Capital, Inc.	3.30%	02/15/2026	17,897	17,909,500	0.1
Marriott International, Inc./MD, Series EE	5.75%	05/01/2025	8,578	9,855,438	0.1
MDC Holdings, Inc.	6.00%	01/15/2043	3,723	4,800,039	0.0
Owens Corning	7.00%	12/01/2036	1,449	2,119,073	0.0
PulteGroup, Inc.	5.00%	01/15/2027	5,635	6,583,769	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
PulteGroup, Inc.	7.88%	06/15/2032	USD 2,595	\$ 3,786,912	0.0%
Resorts World Las Vegas LLC/RWLV Capital, Inc.	4.63%	04/06/2031	20,600	21,230,159	0.1
				<u>66,284,890</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Ross Stores, Inc.	4.70%	04/15/2027	14,291	16,577,105	0.1
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Altria Group, Inc.	4.80%	02/14/2029	38,826	45,148,140	0.2
Zimmer Biomet Holdings, Inc.	3.55%	03/20/2030	21,350	23,621,472	0.1
				<u>68,769,612</u>	<u>0.3</u>
ENERGIE					
Boardwalk Pipelines LP.	4.45%	07/15/2027	6,893	7,791,556	0.0
Boardwalk Pipelines LP.	4.80%	05/03/2029	19,313	22,341,314	0.1
Boardwalk Pipelines LP.	4.95%	12/15/2024	11,272	12,544,834	0.1
Boardwalk Pipelines LP.	5.95%	06/01/2026	2,580	3,045,563	0.0
Cenovus Energy, Inc.	4.40%	04/15/2029	8,488	9,539,119	0.0
Cenovus Energy, Inc.	5.38%	07/15/2025	19,194	21,788,907	0.1
Cenovus Energy, Inc.	6.75%	11/15/2039	428	578,625	0.0
Continental Resources, Inc./OK.	5.75%	01/15/2031	26,213	31,951,285	0.1
Enable Midstream Partners LP.	4.40%	03/15/2027	71,587	79,652,464	0.3
Enable Midstream Partners LP.	4.95%	05/15/2028	6,435	7,319,753	0.0
Enbridge Energy Partners LP.	7.38%	10/15/2045	6,505	10,417,309	0.0
Energy Transfer LP.	5.50%	06/01/2027	23,075	27,203,960	0.1
Energy Transfer LP.	8.25%	11/15/2029	11,355	15,630,949	0.1
Eni SpA.	4.25%	05/09/2029	12,712	14,601,968	0.1
Eni SpA, Series X-R.	4.75%	09/12/2028	1,500	1,768,631	0.0
Hess Corp.	7.30%	08/15/2031	45,274	61,559,980	0.2
Hess Corp.	7.88%	10/01/2029	16,239	22,177,893	0.1
Kinder Morgan Energy Partners LP.	7.30%	08/15/2033	9,000	12,814,060	0.1
Marathon Oil Corp.	3.85%	06/01/2025	16,103	17,789,255	0.1
Marathon Oil Corp.	4.40%	07/15/2027	1,500	1,696,430	0.0
Marathon Oil Corp.	6.80%	03/15/2032	10,144	13,341,524	0.1
ONEOK Partners LP.	4.90%	03/15/2025	5,360	5,978,442	0.0
ONEOK, Inc.	4.35%	03/15/2029	21,411	24,290,613	0.1
ONEOK, Inc.	5.85%	01/15/2026	33,260	39,139,671	0.2
Plains All American Pipeline LP/PAA Finance Corp.	4.50%	12/15/2026	9,649	10,829,266	0.0
Saudi Arabian Oil Co.	2.25%	11/24/2030	3,461	3,443,695	0.0
Suncor Energy, Inc.	7.15%	02/01/2032	12,130	17,062,929	0.1
Tennessee Gas Pipeline Co.	7.00%	10/15/2028	19,360	25,303,058	0.1
				<u>521,603,053</u>	<u>2.1</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Expedia Group, Inc.	6.25%	05/01/2025	3,415	3,944,378	0.0
TECHNOLOGIE					
Broadcom, Inc.	4.11%	09/15/2028	12,958	14,543,153	0.1
Broadcom, Inc.	5.00%	04/15/2030	61,106	72,477,519	0.3
Dell International LLC/EMC Corp.	4.90%	10/01/2026	25,766	29,821,308	0.1
Leidos, Inc.	7.13%	07/01/2032	2,000	2,722,835	0.0
VMware, Inc.	4.50%	05/15/2025	28,904	32,289,723	0.1
				<u>151,854,538</u>	<u>0.6</u>
TRANSPORTWESEN – FLUGGESELLSCHAFTEN					
Delta Air Lines, Inc.	7.00%	05/01/2025	38,037	44,507,369	0.2
Delta Air Lines, Inc./SkyMiles IP Ltd.	4.75%	10/20/2028	31,075	34,532,094	0.1
Mileage Plus Holdings LLC/Mileage Plus Intellectual Property Assets Ltd.	6.50%	06/20/2027	59,148	64,334,825	0.3
Southwest Airlines Co.	5.25%	05/04/2025	29,206	33,109,174	0.1
				<u>176,483,462</u>	<u>0.7</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
BNSF Funding Trust I.	6.61%	12/15/2055	5,597	6,427,444	0.0
				<u>1,442,758,032</u>	<u>5.8</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Enel Finance International NV.	3.63%	05/25/2027	8,791	9,758,546	0.0
NRG Energy, Inc.	3.75%	06/15/2024	10,265	10,945,110	0.1
				<u>20,703,656</u>	<u>0.1</u>
				<u>3,981,308,684</u>	<u>16.0</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
STAATSANLEIHEN					
ANGOLA					
Angolan Government International Bond.	8.00%	11/26/2029	17,946	18,857,881	0.1
Angolan Government International Bond.	9.50%	11/12/2025	12,861	14,346,446	0.0
				<u>33,204,327</u>	<u>0.1</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
BRASILIEN	Brazilian Government International Bond	8.25%	01/20/2034	USD 15,326	\$ 20,999,494	0.1%
KOLUMBIEN	Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	4,454	4,347,661	0.0
	Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	47,384	46,223,092	0.2
	Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	11,769	13,109,930	0.1
	Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	29,991	34,973,255	0.1
	Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	9,114	11,775,858	0.0
					<u>110,429,796</u>	<u>0.4</u>
COSTA RICA	Costa Rica Government International Bond	4.25%	01/26/2023	18,005	18,407,862	0.1
	Costa Rica Government International Bond	4.38%	04/30/2025	5,510	5,698,717	0.0
	Costa Rica Government International Bond	6.13%	02/19/2031	16,855	17,885,262	0.1
					<u>41,991,841</u>	<u>0.2</u>
DOMINIKANISCHE REPUBLIK	Dominican Republic International Bond	4.50%	01/30/2030	75,271	78,225,387	0.4
	Dominican Republic International Bond	4.88%	09/23/2032	19,203	20,124,744	0.1
	Dominican Republic International Bond	5.95%	01/25/2027	33,150	37,583,812	0.1
	Dominican Republic International Bond	6.00%	07/19/2028	8,000	9,160,000	0.0
	Dominican Republic International Bond	6.88%	01/29/2026	45,042	52,426,073	0.2
	Dominican Republic International Bond	8.63%	04/20/2027	2,096	2,560,133	0.0
					<u>200,080,149</u>	<u>0.8</u>
ECUADOR	Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	3,678	2,073,683	0.0
	Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	9,839	6,284,414	0.0
	Ecuador Government International Bond	1.00%	07/31/2035	26,864	19,342,137	0.1
	Ecuador Government International Bond	5.00%	07/31/2030	12,724	11,372,428	0.1
					<u>39,072,662</u>	<u>0.2</u>
ÄGYPTEN	Egypt Government International Bond	4.55%	11/20/2023	6,150	6,372,938	0.0
	Egypt Government International Bond	5.75%	05/29/2024	62,050	65,939,759	0.3
	Egypt Government International Bond	6.13%	01/31/2022	25,211	25,546,621	0.1
	Egypt Government International Bond	6.59%	02/21/2028	9,640	10,162,970	0.0
	Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	6,969	7,213,124	0.0
	Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	64,615	71,613,612	0.3
	Egypt Government International Bond	7.60%	03/01/2029	19,783	21,647,548	0.1
	Egypt Government International Bond	7.63%	05/29/2032	62,112	66,180,336	0.3
					<u>274,676,908</u>	<u>1.1</u>
EL SALVADOR	El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	23,539	20,773,167	0.1
	El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	15,000	12,975,000	0.1
	El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	9,532	7,780,495	0.0
	El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	13,501	12,454,673	0.0
					<u>53,983,335</u>	<u>0.2</u>
GHANA	Ghana Government International Bond	6.38%	02/11/2027	53,977	52,722,035	0.2
	Ghana Government International Bond	7.75%	04/07/2029	12,555	12,633,469	0.1
	Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027	34,165	35,110,943	0.1
	Ghana Government International Bond	8.13%	01/18/2026	7,000	7,246,313	0.0
	Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	7,000	6,999,125	0.0
	Ghana Government International Bond	8.63%	04/07/2034	10,289	10,391,890	0.1
	Ghana Government International Bond	10.75%	10/14/2030	4,326	5,405,607	0.0
					<u>130,509,382</u>	<u>0.5</u>
HONDURAS	Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	15,391	17,009,941	0.1
ELFENBEINKÜSTE	Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	18,113	19,848,452	0.1
	Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	39,769	44,275,324	0.2
					<u>64,123,776</u>	<u>0.3</u>
KENIA	Kenya Government International Bond	7.00%	05/22/2027	19,297	21,200,167	0.1
	Kenya Government International Bond	7.25%	02/28/2028	11,890	13,341,323	0.1
	Republic of Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024	10,777	11,843,249	0.0
					<u>46,384,739</u>	<u>0.2</u>
MEXIKO	Mexico Government International Bond	3.90%	04/27/2025	6,294	6,969,818	0.0
	Mexico Government International Bond	4.75%	04/27/2032	15,488	17,915,744	0.1
					<u>24,885,562</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NIGERIA					
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	USD 67,881	\$ 71,478,693	0.3%
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/21/2025	50,425	56,382,773	0.2
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	13,971	14,030,377	0.1
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	12,210	12,483,199	0.1
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	5,591	6,004,384	0.0
				<u>160,379,426</u>	<u>0.7</u>
PAKISTAN					
Pakistan Government International Bond	6.00%	04/08/2026	12,053	12,114,591	0.0
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	589	602,363	0.0
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	14,261	14,440,831	0.1
				<u>27,157,785</u>	<u>0.1</u>
PANAMA					
Panama Notas del Tesoro	3.75%	04/17/2026	32,190	34,690,761	0.1
PERU					
Peruvian Government International Bond	2.39%	01/23/2026	1,120	1,160,460	0.0
Peruvian Government International Bond	2.78%	01/23/2031	3,069	3,136,710	0.0
				<u>4,297,170</u>	<u>0.0</u>
SENEGAL					
Senegal Government International Bond	6.25%	05/23/2033	43,004	46,291,118	0.2
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	36,542	37,964,854	0.1
				<u>84,255,972</u>	<u>0.3</u>
SÜDAFRIKA					
Republic of South Africa Government International Bond	4.30%	10/12/2028	1,836	1,895,441	0.0
Republic of South Africa Government International Bond	4.85%	09/30/2029	26,842	28,365,283	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	26,967	27,081,610	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	63,767	64,157,573	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	09/16/2025	17,700	19,993,256	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	5.88%	06/22/2030	18,326	20,814,900	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	6.30%	06/22/2048	14,391	15,535,984	0.1
				<u>177,844,047</u>	<u>0.7</u>
UKRAINE					
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2033	56,094	59,435,099	0.2
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	68,051	72,721,000	0.3
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2024	10,000	11,125,000	0.1
				<u>143,281,099</u>	<u>0.6</u>
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE					
Abu Dhabi Government International Bond	2.50%	04/16/2025	14,382	15,259,302	0.1
Abu Dhabi Government International Bond	3.13%	04/16/2030	26,198	28,843,998	0.1
Emirate of Dubai Government International Bonds, Series E	5.25%	01/30/2043	8,135	9,284,069	0.0
				<u>53,387,369</u>	<u>0.2</u>
URUGUAY					
Uruguay Government International Bond	7.63%	03/21/2036	7,989	12,204,871	0.0
Uruguay Government International Bond	7.88%	01/15/2033	11,680	17,650,171	0.1
				<u>29,855,042</u>	<u>0.1</u>
				<u>1,772,500,583</u>	<u>7.1</u>
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Anglo American Capital PLC	5.63%	04/01/2030	40,450	49,746,187	0.2
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	4,456	4,689,940	0.0
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/31/2030	20,153	21,553,130	0.1
CSN Inova Ventures	6.75%	01/28/2028	2,018	2,218,539	0.0
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	24,154	25,020,704	0.1
Eldorado Gold Corp.	6.25%	09/01/2029	12,403	12,600,840	0.1
Gold Fields Orogen Holdings BVI Ltd.	5.13%	05/15/2024	8,685	9,430,282	0.0
GTL Trade Finance, Inc./Gerdau Holdings, Inc.	5.89%	04/29/2024	1,431	1,602,094	0.0
GUSAP III LP	4.25%	01/21/2030	9,269	10,250,531	0.1
HTA Group Ltd./Mauritius	7.00%	12/18/2025	20,951	22,159,611	0.1
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	24,497	25,743,407	0.1
Industrias Penoles SAB de CV	5.65%	09/12/2049	4,016	5,118,643	0.0
Nexa Resources SA	5.38%	05/04/2027	23,815	25,065,288	0.1
OCP SA	3.75%	06/23/2031	6,361	6,432,561	0.0
Sasol Financing USA LLC	5.88%	03/27/2024	8,684	9,239,233	0.0
Suzano Austria GmbH	7.00%	03/16/2047	2,823	3,809,815	0.0
Vedanta Resources Finance II PLC	8.95%	03/11/2025	20,226	20,519,338	0.1
Volcan Cia Minera SAA	4.38%	02/11/2026	4,160	4,033,016	0.0
				<u>259,233,159</u>	<u>1.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
INVESTITIONSGÜTER					
Cemex SAB de CV(c)	5.13%	09/08/2169	USD 16,029	\$ 16,734,276	0.1%
Cemex SAB de CV	5.20%	09/17/2030	5,600	6,128,500	0.0
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	6,522	7,350,294	0.0
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	26,107	27,950,807	0.1
Embraer Netherlands Finance BV	6.95%	01/17/2028	14,202	16,162,159	0.1
Klabn Austria GmbH	7.00%	04/03/2049	3,731	4,720,003	0.0
Usiminas International SARL	5.88%	07/18/2026	11,294	12,077,529	0.1
				<u>91,123,568</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Globo Comunicacao e Participacoes SA	4.88%	01/22/2030	8,603	8,806,246	0.1
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	7,314	6,868,551	0.0
VTR Finance NV	6.38%	07/15/2028	6,173	6,557,599	0.0
Weibo Corp.	3.50%	07/05/2024	28,740	30,091,833	0.1
				<u>52,324,229</u>	<u>0.2</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
C&W Senior Financing DAC	6.88%	09/15/2027	21,849	23,177,012	0.1
C&W Senior Financing DAC	7.50%	10/15/2026	3,816	3,971,751	0.0
MTN Mauritius Investments Ltd.	5.37%	02/13/2022	8,533	8,652,547	0.0
Sable International Finance Ltd.	5.75%	09/07/2027	33,419	35,099,865	0.2
				<u>70,901,175</u>	<u>0.3</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
Falabella SA	3.75%	10/30/2027	8,500	9,078,000	0.0
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
BRF SA	4.88%	01/24/2030	27,471	28,329,469	0.2
Kimberly-Clark de Mexico SAB de CV	2.43%	07/01/2031	10,259	10,358,037	0.0
Natura Cosméticos SA	4.13%	05/03/2028	16,514	16,951,621	0.1
NBM US Holdings, Inc.	6.63%	08/06/2029	10,000	11,176,371	0.0
Ulker Biskuvi Sanayi AS	6.95%	10/30/2025	3,907	4,205,641	0.0
				<u>71,021,139</u>	<u>0.3</u>
ENERGIE					
Ecopetrol SA	5.88%	05/28/2045	2,852	3,049,430	0.0
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	24,762	29,813,943	0.1
Empresa Electrica Cochrane SpA	5.50%	05/14/2027	10,385	10,417,599	0.0
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	4,306	3,747,572	0.0
HPCL-Mittal Energy Ltd.	5.45%	10/22/2026	2,624	2,738,472	0.0
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	2,024	2,063,595	0.0
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	11,154	12,200,723	0.1
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	4,339	4,678,798	0.0
Medco Platinum Road Pte Ltd.	6.75%	01/30/2025	18,656	19,464,038	0.1
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	11,384	12,396,018	0.1
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	8,487	8,769,723	0.0
Peru LNG Srl	5.38%	03/22/2030	11,304	8,965,485	0.0
Petrobras Global Finance BV	7.38%	01/17/2027	33,486	40,982,660	0.2
Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026	14,377	18,450,184	0.1
Raizen Fuels Finance SA	5.30%	01/20/2027	16,179	18,364,828	0.1
SEPLAT Energy PLC.	7.75%	04/01/2026	11,120	11,537,000	0.1
SierraCol Energy Andina LLC.	6.00%	06/15/2028	3,645	3,635,459	0.0
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.	4.00%	08/15/2026	25,480	27,661,725	0.1
				<u>238,937,252</u>	<u>1.0</u>
DIENSTLEISTUNGEN					
Stoneco Ltd.	3.95%	06/16/2028	4,218	4,125,773	0.0
TECHNOLOGIE					
Baidu, Inc.	3.43%	04/07/2030	345	373,269	0.0
NXP BV/NXP Funding LLC	5.35%	03/01/2026	21,052	24,430,846	0.1
NXP BV/NXP Funding LLC	5.55%	12/01/2028	1,500	1,831,725	0.0
				<u>26,635,840</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – EISENBAHNEN					
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	4,574	4,888,353	0.0
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	9,613	11,330,480	0.1
				<u>16,218,833</u>	<u>0.1</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Adani Ports & Special Economic Zone Ltd.	4.00%	07/30/2027	23,925	25,178,072	0.1
				<u>864,777,040</u>	<u>3.5</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Absa Group Ltd.(c)	6.38%	05/27/2026	4,093	4,277,185	0.0
Banco de Credito del Peru	3.13%	07/01/2030	20,748	20,631,293	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Banco Santander Mexico SA Institucion de Banca Multiple					
Grupo Financiero Santand.....	5.38%	04/17/2025	USD 23,905	\$ 27,031,774	0.1%
BBVA Bancomer SA/Texas.....	5.88%	09/13/2034	26,946	29,571,753	0.1
				<u>81,512,005</u>	<u>0.3</u>
FINANZEN					
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.....	4.75%	04/27/2027	400	396,000	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.....	4.63%	06/03/2026	200	198,000	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.....	5.00%	11/19/2025	12,192	12,252,960	0.0
Huarong Finance II Co., Ltd.....	5.50%	01/16/2025	39,399	40,186,980	0.2
				<u>53,033,940</u>	<u>0.2</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
OEC Finance Ltd.(b).....	4.38%	10/25/2029	4,709	476,419	0.0
OEC Finance Ltd.(b).....	7.13%	12/26/2046	11,609	1,092,791	0.0
				<u>1,569,210</u>	<u>0.0</u>
REITs					
Central China Real Estate Ltd.....	7.50%	07/14/2025	1,176	894,105	0.0
Central China Real Estate Ltd.....	7.75%	05/24/2024	200	154,629	0.0
China Aoyuan Group Ltd.....	5.38%	09/13/2022	531	516,548	0.0
China Aoyuan Group Ltd.....	5.88%	03/01/2027	200	166,450	0.0
Ronshine China Holdings Ltd.....	7.10%	01/25/2025	469	403,721	0.0
Trust Fibra Uno.....	4.87%	01/15/2030	29,764	32,708,775	0.2
Yango Justice International Ltd.....	7.50%	02/17/2025	1,019	871,245	0.0
Yuzhou Group Holdings Co., Ltd.....	6.35%	01/13/2027	200	151,223	0.0
				<u>35,866,696</u>	<u>0.2</u>
				<u>171,981,851</u>	<u>0.7</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Adani Transmission Ltd.....	4.00%	08/03/2026	15,853	16,938,851	0.1
AES Andes SA.....	6.35%	10/07/2079	12,300	12,853,500	0.1
AES Panama Generation Holdings SRL.....	4.38%	05/31/2030	11,919	12,349,573	0.0
Consorcio Transmantaro SA.....	4.38%	05/07/2023	30,911	32,133,916	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP.....	4.25%	07/18/2029	24,989	24,842,190	0.1
Empresas Publicas de Medellin ESP.....	4.38%	02/15/2031	19,852	19,554,220	0.1
Infraestructura Energetica Nova SAB de CV.....	3.75%	01/14/2028	7,817	8,458,483	0.0
Kallpa Generacion SA.....	4.13%	08/16/2027	4,972	5,122,092	0.0
Light Servicos De Eletricidade.....	4.38%	06/18/2026	8,905	9,049,818	0.0
LLPL Capital Pte Ltd.....	6.88%	02/04/2039	9,966	11,718,058	0.1
Star Energy Geothermal Wayang Windu Ltd.....	6.75%	04/24/2033	12,637	14,503,612	0.1
				<u>167,524,313</u>	<u>0.7</u>
				<u>2,976,783,787</u>	<u>12.0</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-3A, Class M1B(d).....	1.93%	10/25/2028	4,778	4,784,292	0.0
Series 2019-1A, Class M2(d).....	2.78%	03/25/2029	13,043	13,109,185	0.1
Series 2019-2A, Class M1C(d).....	2.08%	04/25/2029	51,941	52,236,356	0.2
Series 2019-3A, Class M1C(d).....	2.03%	07/25/2029	69,349	69,348,965	0.3
Series 2019-4A, Class M1B(d).....	2.08%	10/25/2029	3,890	3,892,417	0.0
Series 2019-4A, Class M1C(d).....	2.58%	10/25/2029	25,958	25,957,849	0.1
Series 2019-4A, Class M2(d).....	2.93%	10/25/2029	40,849	41,335,906	0.2
Series 2020-3A, Class M2(d).....	4.93%	10/25/2030	4,250	4,543,017	0.0
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1M2(d).....	2.48%	04/25/2031	3,508	3,524,049	0.0
Series 2019-R01, Class 2M2(d).....	2.53%	07/25/2031	33,699	33,868,617	0.1
Series 2019-R05, Class 1M2(d).....	2.08%	07/25/2039	5,735	5,751,312	0.0
Series 2019-R06, Class 2M2(d).....	2.18%	09/25/2039	14,346	14,393,447	0.1
Eagle RE Ltd., Series 2018-1, Class M1(d).....	1.78%	11/25/2028	2,145	2,146,687	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured					
Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2013-DN2, Class M2(d).....	4.33%	11/25/2023	10,088	10,316,002	0.0
Series 2014-DN4, Class M3(d).....	4.63%	10/25/2024	10,678	10,918,640	0.0
Series 2014-HQ1, Class M3(d).....	4.18%	08/25/2024	3,219	3,241,885	0.0
Series 2014-HQ2, Class M3(d).....	3.83%	09/25/2024	2,195	2,261,321	0.0
Series 2014-HQ3, Class M3(d).....	4.83%	10/25/2024	1,119	1,124,319	0.0
Series 2015-DNA1, Class M3(d).....	3.38%	10/25/2027	3,031	3,080,291	0.0
Series 2015-DNA3, Class M3(d).....	4.78%	04/25/2028	12,583	12,920,984	0.1
Series 2015-HQA1, Class M3(d).....	4.78%	03/25/2028	22,054	22,613,851	0.1
Series 2015-HQA2, Class M3(d).....	4.88%	05/25/2028	22,251	22,897,922	0.1
Series 2016-DNA1, Class M3(d).....	5.63%	07/25/2028	29,723	31,069,479	0.1
Series 2016-DNA3, Class M3(d).....	5.08%	12/25/2028	62,661	65,228,783	0.3
Series 2016-DNA4, Class M3(d).....	3.88%	03/25/2029	46,887	48,363,943	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2016-HQA1, Class M3(d)	6.43%	09/25/2028	USD 33,789	\$ 35,395,811	0.1%
Series 2016-HQA2, Class M3(d)	5.23%	11/25/2028	15,340	15,849,390	0.1
Series 2017-DNA2, Class M2(d)	3.53%	10/25/2029	15,257	15,772,372	0.1
Series 2017-DNA3, Class B1(d)	4.53%	03/25/2030	9,000	9,506,035	0.0
Series 2017-DNA3, Class M2(d)	2.58%	03/25/2030	10,335	10,542,066	0.0
Series 2017-HQA1, Class M2(d)	3.63%	08/25/2029	63,556	65,428,647	0.3
Series 2017-HQA3, Class M2(d)	2.43%	04/25/2030	49,805	50,661,468	0.2
Series 2018-HQA1, Class M2(d)	2.38%	09/25/2030	46,000	46,589,847	0.2
Series 2018-HQA2, Class M2(d)	2.38%	10/25/2048	28,000	28,246,501	0.1
Series 2019-DNA1, Class M2(d)	2.73%	01/25/2049	62,400	63,199,929	0.3
Series 2019-DNA2, Class M2(d)	2.53%	03/25/2049	24,850	25,177,310	0.1
Series 2019-DNA3, Class M2(d)	2.13%	07/25/2049	27,534	27,798,870	0.1
Series 2019-FTR2, Class M2(d)	2.23%	11/25/2048	13,128	13,136,279	0.1
Series 2019-HQA1, Class M2(d)	2.43%	02/25/2049	46,604	47,067,286	0.2
Series 2019-HQA2, Class M2(d)	2.13%	04/25/2049	35,003	35,112,882	0.1
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(d)	5.33%	10/25/2023	2,262	2,353,572	0.0
Series 2014-C01, Class M2(d)	4.48%	01/25/2024	1,680	1,734,294	0.0
Series 2014-C04, Class 1M2(d)	4.98%	11/25/2024	11,394	11,725,389	0.1
Series 2014-C04, Class 2M2(d)	5.08%	11/25/2024	1,553	1,585,023	0.0
Series 2015-C02, Class 1M2(d)	4.08%	05/25/2025	22,723	23,113,965	0.1
Series 2015-C02, Class 2M2(d)	4.08%	05/25/2025	3,867	3,877,957	0.0
Series 2015-C03, Class 1M2(d)	5.08%	07/25/2025	15,617	15,991,216	0.1
Series 2015-C03, Class 2M2(d)	5.08%	07/25/2025	1,997	2,016,390	0.0
Series 2015-C04, Class 1M2(d)	5.78%	04/25/2028	52,476	55,202,762	0.2
Series 2015-C04, Class 2M2(d)	5.63%	04/25/2028	27,220	28,550,401	0.1
Series 2016-C01, Class 1M2(d)	6.83%	08/25/2028	16,464	17,408,908	0.1
Series 2016-C01, Class 2M2(d)	7.03%	08/25/2028	9,429	9,928,157	0.0
Series 2016-C02, Class 1M2(d)	6.08%	09/25/2028	37,706	39,461,841	0.2
Series 2016-C03, Class 1M2(d)	5.38%	10/25/2028	18,543	19,491,937	0.1
Series 2016-C03, Class 2M2(d)	5.98%	10/25/2028	27,311	28,660,551	0.1
Series 2016-C04, Class 1M2(d)	4.33%	01/25/2029	26,098	27,130,920	0.1
Series 2016-C05, Class 2M2(d)	4.53%	01/25/2029	21,705	22,524,750	0.1
Series 2016-C06, Class 1M2(d)	4.33%	04/25/2029	27,386	28,287,027	0.1
Series 2016-C07, Class 2M2(d)	4.43%	05/25/2029	15,649	16,251,557	0.1
Series 2017-C01, Class 1M2(d)	3.63%	07/25/2029	21,990	22,632,922	0.1
Series 2017-C02, Class 2B1(d)	5.58%	09/25/2029	16,013	17,473,838	0.1
Series 2017-C02, Class 2M2(d)	3.73%	09/25/2029	29,890	30,917,729	0.1
Series 2017-C03, Class 1B1(d)	4.93%	10/25/2029	10,420	11,306,116	0.0
Series 2017-C06, Class 1M2(d)	2.73%	02/25/2030	6,628	6,743,546	0.0
Series 2017-C07, Class 1B1(d)	4.08%	05/25/2030	5,472	5,669,434	0.0
Series 2018-C02, Class 2M2(d)	2.28%	08/25/2030	36,458	36,729,792	0.2
Series 2018-C05, Class 1M2(d)	2.43%	01/25/2031	36,364	36,782,118	0.2
Series 2018-C06, Class 2M2(d)	2.18%	03/25/2031	8,458	8,522,660	0.0
Home Re Ltd., Series 2018-1, Class M1(d)	1.68%	10/25/2028	5,641	5,641,039	0.0
Oaktown Re II Ltd., Series 2018-1A, Class M1(d)	1.63%	07/25/2028	380	380,058	0.0
Oaktown Re III Ltd.					
Series 2019-1A, Class M1B(d)	2.03%	07/25/2029	3,141	3,141,370	0.0
Series 2019-1A, Class M2(d)	2.63%	07/25/2029	23,910	24,055,785	0.1
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(d)	5.33%	10/25/2030	4,014	4,223,809	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-1R, Class A(d)	2.09%	03/27/2024	11,105	11,089,584	0.0
Series 2019-2R, Class A(d)	2.84%	05/27/2023	22,728	22,521,616	0.1
Series 2019-3R, Class A(d)	2.79%	10/27/2022	8,443	8,467,563	0.0
Radnor Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(d)	2.03%	02/25/2029	12,742	12,749,273	0.1
Series 2019-2, Class M1B(d)	1.83%	06/25/2029	31,085	31,145,148	0.1
Series 2020-1, Class M1B(d)	1.53%	01/25/2030	22,546	22,590,253	0.1
Series 2020-1, Class M1C(d)	1.83%	01/25/2030	8,262	8,226,257	0.0
Triangle Re Ltd., Series 2020-1, Class M1C(d)	4.58%	10/25/2030	19,080	19,386,373	0.1
				<u>1,704,107,112</u>	<u>6.8</u>
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2018-1A, Class B1(d)	4.33%	04/25/2028	2,270	2,281,258	0.0
Series 2019-2A, Class M2(d)	3.18%	04/25/2029	5,000	5,071,525	0.0
Eagle Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(d)	1.88%	04/25/2029	1,278	1,278,127	0.0
Series 2019-1, Class M2(d)	3.38%	04/25/2029	5,236	5,287,909	0.0
Series 2020-1, Class M2(d)	2.08%	01/25/2030	15,704	15,409,893	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICS					
Series 3119, Class PI(d) (e)	7.10%	02/15/2036	4,614	1,181,121	0.0
Series 3725, Class CS(d) (e)	5.90%	05/15/2040	29,730	3,888,679	0.0
Series 3898, Class NS(d) (e)	5.83%	07/15/2041	7,230	1,245,523	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 3921, Class SB(d) (e)	6.46%	09/15/2041	USD 15,143	\$ 3,316,466	0.0%
Series 3928, Class SE(d) (e)	6.48%	09/15/2041	13,514	2,932,542	0.0
Series 4125, Class SA(d) (e)	6.05%	11/15/2042	8,915	1,817,843	0.0
Series 4248, Class SL(d) (e)	5.95%	05/15/2041	2,597	441,509	0.0
Series 4292, Class S(d) (e)	5.95%	01/15/2044	3,456	673,121	0.0
Series 4317, Class SD(d) (e)	7.10%	08/15/2035	8,257	1,896,650	0.0
Series 4372, Class JS(d) (e)	6.00%	08/15/2044	20,314	4,254,973	0.0
Series 4373, Class SA(d) (e)	6.05%	08/15/2044	12,149	2,824,070	0.0
Series 4494, Class SL(d) (e)	6.12%	07/15/2045	39,495	8,281,106	0.1
Series 4495, Class SA(d) (e)	6.05%	07/15/2045	9,315	2,165,017	0.0
Series 4570, Class ST(d) (e)	5.90%	04/15/2046	10,611	2,551,874	0.0
Series 4585, Class DS(d) (e)	5.90%	05/15/2046	19,814	4,869,673	0.0
Series 4593, Class SA(d) (e)	5.90%	06/15/2046	13,719	3,356,918	0.0
Series 4656, Class SK(d) (e)	5.95%	02/15/2047	11,046	2,374,760	0.0
Series 4707, Class LS(d) (e)	6.05%	08/15/2047	13,985	2,728,080	0.0
Series 4719, Class SA(d) (e)	6.05%	09/15/2047	11,666	2,614,050	0.0
Series 4719, Class SB(d) (e)	6.05%	09/15/2047	21,181	5,122,565	0.0
Series 4727, Class AS(d) (e)	6.10%	11/15/2047	18,984	4,299,655	0.0
Series 4735, Class SA(d) (e)	6.10%	12/15/2047	31,860	8,229,602	0.1
Series 4736, Class LS(d) (e)	6.10%	12/15/2047	13,711	3,057,137	0.0
Series 4736, Class SM(d) (e)	6.10%	12/15/2047	28,519	5,816,437	0.1
Series 4754, Class QS(d) (e)	6.05%	02/15/2048	18,304	3,684,845	0.0
Series 4767, Class SB(d) (e)	6.10%	03/15/2048	7,915	1,532,549	0.0
Series 4824, Class KS(d) (e)	6.10%	09/15/2048	7,285	1,242,248	0.0
Series 4906, Class SA(d) (e)	5.97%	09/25/2049	36,791	7,798,302	0.1
Series 4906, Class SN(d) (e)	5.97%	09/25/2049	28,809	6,605,813	0.1
Series 4927, Class SJ(d) (e)	5.97%	11/25/2049	22,922	4,843,783	0.0
Series 4932, Class SM(d) (e)	5.97%	06/25/2049	35,722	5,948,844	0.1
Series 4954, Class SL(d) (e)	5.97%	02/25/2050	397	74,116	0.0
Series 4981, Class HS(d) (e)	6.02%	06/25/2050	110,215	20,525,478	0.1
Series 4981, Class JS(d) (e)	6.02%	06/25/2050	176,966	32,961,684	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency Credit Risk Debt Notes					
Series 2016-HQA3, Class M3(d)	3.93%	03/25/2029	3,097	3,186,201	0.0
Series 2017-DNA1, Class B1(d)	5.03%	07/25/2029	1,500	1,616,310	0.0
Series 2017-DNA2, Class B1(d)	5.23%	10/25/2029	2,809	3,068,959	0.0
Federal National Mortgage Association Connecticut Avenue Securities, Series 2014-C03, Class 2M2(d)					
	2.98%	07/25/2024	754	766,110	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2005-58, Class IK(d) (e)	5.92%	07/25/2035	8,641	1,973,695	0.0
Series 2006-8, Class JH(d) (e)	6.52%	03/25/2036	11,253	2,630,984	0.0
Series 2011-146, Class SA(d) (e)	5.92%	01/25/2042	11,481	2,266,767	0.0
Series 2012-122, Class LS(d) (e)	6.02%	11/25/2042	9,685	2,338,886	0.0
Series 2012-122, Class MS(d) (e)	6.02%	11/25/2042	11,245	2,652,070	0.0
Series 2012-17, Class ES(d) (e)	6.47%	03/25/2041	1,745	216,059	0.0
Series 2012-17, Class SE(d) (e)	5.87%	03/25/2042	9,346	2,377,894	0.0
Series 2012-7, Class QS(d) (e)	5.92%	02/25/2042	13,923	2,756,451	0.0
Series 2012-70, Class HS(d) (e)	5.92%	07/25/2042	16,432	3,255,034	0.0
Series 2013-15, Class SA(d) (e)	6.07%	03/25/2043	8,900	2,016,201	0.0
Series 2013-4, Class ST(d) (e)	6.07%	02/25/2043	8,867	1,800,452	0.0
Series 2013-62, Class SA(d) (e)	6.62%	06/25/2043	14,033	3,393,454	0.0
Series 2014-17, Class SB(d) (e)	5.97%	04/25/2044	10,948	2,654,125	0.0
Series 2014-28, Class SB(d) (e)	5.97%	05/25/2044	9,952	2,357,865	0.0
Series 2014-35, Class CS(d) (e)	6.07%	06/25/2044	15,323	2,677,625	0.0
Series 2014-40, Class HS(d) (e)	6.62%	07/25/2044	6,820	1,839,675	0.0
Series 2014-78, Class SA(d) (e)	6.02%	12/25/2044	5,531	1,201,231	0.0
Series 2014-88, Class BS(d) (e)	6.07%	01/25/2045	9,723	2,210,880	0.0
Series 2015-26, Class SH(d) (e)	6.37%	05/25/2045	14,217	3,068,895	0.0
Series 2015-57, Class AS(d) (e)	6.17%	08/25/2045	52,023	10,164,933	0.1
Series 2015-90, Class SL(d) (e)	6.07%	12/25/2045	12,016	2,499,628	0.0
Series 2016-29, Class SA(d) (e)	5.92%	05/25/2046	14,031	3,151,573	0.0
Series 2016-60, Class SA(d) (e)	6.02%	09/25/2046	32,314	5,588,846	0.0
Series 2016-65, Class AS(d) (e)	6.02%	09/25/2046	13,870	2,610,477	0.0
Series 2016-89, Class SH(d) (e)	5.92%	12/25/2046	7,321	1,465,346	0.0
Series 2017-105, Class SE(d) (e)	6.07%	01/25/2048	50,496	12,074,807	0.1
Series 2017-109, Class SJ(d) (e)	6.12%	01/25/2048	4,663	838,758	0.0
Series 2017-112, Class SA(d) (e)	6.07%	01/25/2048	15,482	2,769,288	0.0
Series 2017-20, Class SJ(d) (e)	6.02%	04/25/2047	32,414	7,420,760	0.1
Series 2017-26, Class TS(d) (e)	5.87%	04/25/2047	10,252	2,326,582	0.0
Series 2017-35, Class LS(d) (e)	6.07%	05/25/2047	32,702	8,131,412	0.1
Series 2017-38, Class DS(d) (e)	6.12%	05/25/2047	14,466	1,464,350	0.0
Series 2017-38, Class SE(d) (e)	6.02%	05/25/2047	24,329	5,207,200	0.0
Series 2017-49, Class SP(d) (e)	6.07%	07/25/2047	8,934	2,163,742	0.0
Series 2017-81, Class CS(d) (e)	6.12%	10/25/2047	11,192	2,228,871	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2017-85, Class HS(d) (e)	6.12%	11/25/2047	USD 16,526	\$ 3,951,018	0.0%
Series 2018-13, Class SG(d) (e)	6.07%	03/25/2048	10,119	2,029,990	0.0
Series 2018-28, Class PS(d) (e)	6.12%	05/25/2048	18,663	3,864,443	0.0
Series 2018-28, Class SB(d) (e)	6.12%	05/25/2048	19,171	4,230,576	0.0
Series 2018-30, Class SA(d) (e)	6.12%	05/25/2048	18,801	3,762,099	0.0
Series 2018-32, Class SB(d) (e)	6.12%	05/25/2048	18,235	4,346,628	0.0
Series 2018-39, Class AS(d) (e)	6.12%	06/25/2048	9,705	2,191,660	0.0
Series 2018-45, Class SL(d) (e)	6.12%	06/25/2048	12,847	3,233,818	0.0
Series 2018-47, Class SD(d) (e)	6.12%	07/25/2048	29,116	5,489,431	0.0
Series 2018-63, Class KS(d) (e)	6.12%	09/25/2048	8,196	1,397,774	0.0
Series 2018-96, Class SC(d) (e)	5.97%	10/25/2035	7,247	1,248,776	0.0
Series 2019-13, Class SA(d) (e)	5.92%	04/25/2049	18,546	3,113,505	0.0
Series 2019-25, Class SA(d) (e)	5.97%	06/25/2049	40,037	7,658,689	0.1
Series 2019-31, Class SJ(d) (e)	6.02%	07/25/2049	7,753	1,839,138	0.0
Series 2019-37, Class US(d) (e)	5.97%	07/25/2049	16,372	2,558,933	0.0
Series 2019-38, Class SM(d) (e)	5.97%	07/25/2049	8,716	1,828,914	0.0
Series 2019-42, Class SQ(d) (e)	5.97%	08/25/2049	26,483	4,960,012	0.0
Series 2019-48, Class SA(d) (e)	6.12%	12/25/2039	28,042	6,954,342	0.1
Series 2019-48, Class SM(d) (e)	5.97%	07/25/2039	10,442	2,649,085	0.0
Series 2019-60, Class SJ(d) (e)	5.97%	10/25/2049	26,376	5,671,794	0.0
Series 2019-65, Class SY(d) (e)	5.97%	11/25/2049	17,186	3,470,111	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-160, Class SP(d) (e)	5.51%	10/20/2044	17,075	3,229,208	0.0
Series 2017-103, Class SL(d) (e)	6.11%	07/20/2047	22,624	4,616,799	0.0
Series 2017-115, Class SA(d) (e)	6.11%	07/20/2047	16,059	3,654,585	0.0
Series 2017-122, Class SA(d) (e)	6.11%	08/20/2047	21,275	4,701,933	0.0
Series 2017-134, Class SE(d) (e)	6.11%	09/20/2047	10,127	1,659,837	0.0
Series 2017-149, Class SG(d) (e)	6.11%	10/20/2047	15,453	3,175,997	0.0
Series 2017-52, Class SN(d) (e)	6.06%	04/20/2047	6,208	1,143,066	0.0
Series 2020-47, Class SG(d) (e)	5.91%	02/20/2049	19,133	3,419,373	0.0
Home Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M2(d)	3.08%	10/25/2028	1,062	1,072,989	0.0
Series 2019-1, Class M2(d)	3.33%	05/25/2029	5,400	5,467,860	0.0
Radnor Re Ltd.					
Series 2018-1, Class M2(d)	2.78%	03/25/2028	9,240	9,326,091	0.1
Series 2019-1, Class M2(d)	3.28%	02/25/2029	12,181	12,303,010	0.1
				<u>447,139,625</u>	<u>1.8</u>
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4398, Class IO(f)	6.00%	10/15/2037	16,891	3,577,635	0.0
Series 4913, Class IO(f)	6.00%	04/15/2041	7,683	1,755,027	0.0
Series 4933, Class IO(f)	5.00%	03/15/2049	9,438	1,623,071	0.0
Series 4976, Class MI(f)	4.50%	05/25/2050	44,138	7,518,704	0.1
Series 4981, Class MI(f)	5.00%	06/25/2050	69,729	12,404,494	0.1
Series 4987, Class IC(f)	4.50%	06/25/2050	166,034	23,755,991	0.1
Series 4993, Class LI(f)	5.00%	07/25/2050	20,460	2,983,714	0.0
Series 5008, Class AI(f)	3.50%	09/25/2050	18,399	2,771,545	0.0
Series 5011, Class MI(f)	3.00%	09/25/2050	17,381	2,633,525	0.0
Series 5013, Class JI(f)	4.00%	09/25/2050	36,946	4,867,840	0.1
Series 5015, Class BI(f)	4.00%	09/25/2050	26,657	4,641,818	0.0
Series 5018, Class AI(f)	4.00%	10/25/2050	13,999	2,437,686	0.0
Series 5018, Class GI(f)	4.50%	10/25/2050	25,325	3,802,398	0.0
Series 5024, Class DI(f)	4.00%	10/25/2050	6,679	1,016,234	0.0
Series 5030, Class EI(f)	3.50%	10/25/2050	6,442	1,145,269	0.0
Series 5036, Class IT(f)	4.00%	03/25/2050	9,491	1,454,946	0.0
Series 5040, Class AI(f)	3.50%	11/25/2050	2,661	419,840	0.0
Series 5043, Class IO(f)	5.00%	11/25/2050	20,927	3,897,183	0.0
Series 5049, Class CI(f)	3.50%	12/25/2050	31,707	4,059,704	0.0
Series 5052, Class IK(f)	4.00%	12/25/2050	29,235	4,347,531	0.0
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2010-109, Class IM(f)	5.50%	09/25/2040	2,893	440,574	0.0
Series 2014-37, Class AI(f)	5.50%	07/25/2044	5,552	943,203	0.0
Series 2015-22, Class EI(f)	6.00%	04/25/2045	24,510	4,559,953	0.0
Series 2016-11, Class GI(f)	5.00%	03/25/2046	4,974	903,058	0.0
Series 2016-26, Class IO(f)	5.00%	05/25/2046	17,540	2,918,350	0.0
Series 2016-33, Class NI(f)	5.00%	07/25/2034	19,972	3,346,465	0.0
Series 2016-34, Class AI(f)	5.00%	06/25/2046	17,989	2,999,922	0.0
Series 2016-37, Class BI(f)	5.00%	06/25/2046	31,690	5,250,925	0.1
Series 2016-64, Class BI(f)	5.00%	09/25/2046	30,236	4,834,200	0.0
Series 2018-54, Class IO(f)	5.50%	08/25/2048	10,373	1,938,668	0.0
Series 2020-89, Class KI(f)	4.00%	12/25/2050	96,411	14,200,149	0.1
Series 2020-96, Class KI(f)	2.50%	01/25/2051	8,048	927,210	0.0
Series 2021-18, Class IT(f)	3.00%	04/25/2051	18,895	1,948,968	0.0

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Government National Mortgage Association					
Series 2015-62, Class GI(f)	6.50%	05/20/2045	USD 19,859	\$ 4,227,074	0.0%
Series 2019-57, Class IO(f)	5.50%	05/20/2049	6,497	1,203,358	0.0
				<u>141,756,232</u>	<u>0.6</u>
				<u>2,293,002,969</u>	<u>9.2</u>
BEHÖRDEN					
SCHULDVERSCHREIBUNGEN VON BEHÖRDEN					
Federal Home Loan Banks	3.25%	06/09/2028	34,000	38,643,023	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.25%	07/15/2032	119,285	177,022,455	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series GDIF	6.75%	09/15/2029	8,750	12,550,745	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.	6.75%	03/15/2031	65,181	96,451,142	0.4
Federal National Mortgage Association	6.25%	05/15/2029	120,037	164,362,602	0.7
Federal National Mortgage Association	6.63%	11/15/2030	358,671	520,925,389	2.1
Federal National Mortgage Association	7.13%	01/15/2030	142,912	208,829,687	0.8
Federal National Mortgage Association	7.25%	05/15/2030	15,000	22,301,781	0.1
Tennessee Valley Authority	7.13%	05/01/2030	19,383	28,415,197	0.1
				<u>1,269,502,021</u>	<u>5.1</u>
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
FONDS UND INVESTMENTTRUSTS					
AB FCP I - Emerging Markets Debt Portfolio - Class SA			625,768	56,024,981	0.2
AB FCP I - Mortgage Income Portfolio - Class SA			1,074,041	85,837,329	0.4
AB SICAV I - Asia Income Opportunities Portfolio - Class ZT			3,097,900	331,661,160	1.3
AB SICAV I - Global Income Portfolio - Class ZT			958,970	95,618,919	0.4
AB SICAV I - Short Duration Income Portfolio - Class S			740,668	75,199,980	0.3
AB SICAV I - US High Yield Portfolio - Class ZT			3,807,731	58,600,981	0.2
				<u>702,943,350</u>	<u>2.8</u>
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN					
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT					
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	3.50%	09/01/2049	5,984	6,465,651	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	4.00%	08/01/2049	1,069	1,160,672	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2019	5.00%	11/01/2049	6,353	7,177,172	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	3.50%	10/01/2049	5,377	5,846,795	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	09/01/2049	4,529	4,945,945	0.0
Federal National Mortgage Association, Series 2019	4.00%	10/01/2049	9,571	10,490,964	0.0
Government National Mortgage Association, Series 2021	3.00%	09/01/2051	225,053	235,268,390	1.0
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021, TBA	4.50%	09/01/2051	102,045	110,383,573	0.5
Uniform Mortgage-Backed Security, Series 2021, TBA	5.00%	09/01/2051	100,693	110,321,575	0.5
				<u>492,060,737</u>	<u>2.0</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.80%	02/10/2036	12,568	13,175,064	0.1
Banc of America Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	2,340	2,555,763	0.0
Series 2016-UB10, Class C	5.02%	07/15/2049	2,354	2,588,348	0.0
Benchmark Mortgage Trust, Series 2019-B11, Class XA(f)	1.20%	05/15/2052	222,129	14,124,228	0.1
CCUBS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-C1,					
Class XA(f)	1.15%	11/15/2050	7,899	333,691	0.0
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(f)					
	1.14%	02/10/2050	102,326	4,472,145	0.0
CFCRE Commercial Mortgage Trust,					
Series 2016-C4, Class AM	3.69%	05/10/2058	390	421,075	0.0
CGMS Commercial Mortgage Trust, Series 2017-B1, Class C	4.31%	08/15/2050	9,500	9,981,742	0.1
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class D	4.56%	04/10/2046	1,201	1,222,752	0.0
Series 2013-GC11, Class XA(f)	1.50%	04/10/2046	7,805	134,607	0.0
Series 2013-GC17, Class C	5.26%	11/10/2046	3,895	4,070,951	0.0
Series 2013-GC17, Class D	5.26%	11/10/2046	5,540	5,123,901	0.0
Series 2015-GC29, Class XA(f)	1.17%	04/10/2048	31,485	1,011,112	0.0
Series 2016-C3, Class XA(f)	1.23%	11/15/2049	183,049	7,183,627	0.0
Series 2016-P3, Class XA(f)	1.85%	04/15/2049	116,411	6,582,783	0.0
Series 2017-P7, Class XA(f)	1.26%	04/14/2050	92,705	4,334,719	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	8,500	4,034,847	0.0
Series 2012-CR3, Class D	4.91%	10/15/2045	3,971	2,710,800	0.0
Series 2012-CR3, Class E	4.91%	10/15/2045	2,959	1,476,882	0.0
Series 2012-CR5, Class C	4.46%	12/10/2045	620	619,399	0.0
Series 2013-CR6, Class D	4.22%	03/10/2046	2,600	2,470,770	0.0
Series 2014-CR15, Class XA(f)	0.86%	02/10/2047	6,950	110,280	0.0
Series 2014-CR16, Class D	5.08%	04/10/2047	12,900	12,206,189	0.1
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	3,622	3,946,726	0.0
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	390	419,886	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(f)	1.06%	10/10/2048	25,277	835,676	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
Series 2015-LC21, Class XA(f)	0.82%	07/10/2048	USD 75,096	\$ 1,652,051	0.0%
Series 2015-PC1, Class C	4.46%	07/10/2050	11,346	12,081,904	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(f)	1.11%	02/10/2049	1,572	54,425	0.0
Series 2017-COR2, Class XA(f)	1.31%	09/10/2050	23,031	1,350,414	0.0
CSAIL Commercial Mortgage Trust, Series 2015-C1, Class D	3.90%	04/15/2050	12,290	9,056,413	0.1
GS Mortgage Securities Corp. II, Series 2013-GC10, Class XA(f)	1.63%	02/10/2046	29,639	487,510	0.0
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2012-GC6, Class B	6.04%	01/10/2045	6,000	6,065,576	0.0
Series 2012-GCJ7, Class A4	3.38%	05/10/2045	208	208,816	0.0
Series 2012-GCJ9, Class AS	3.12%	11/10/2045	10,000	10,232,490	0.1
Series 2013-GC13, Class D	4.22%	07/10/2046	17,538	9,986,135	0.1
Series 2014-GC22, Class C	4.85%	06/10/2047	993	1,041,636	0.0
Series 2016-GS3, Class XA(f)	1.34%	10/10/2049	118,092	5,924,139	0.0
Series 2017-GS5, Class XA(f)	0.99%	03/10/2050	136,106	5,594,164	0.0
Series 2017-GS7, Class XA(f)	1.26%	08/10/2050	83,832	4,179,674	0.0
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2010-C2, Class A3	4.07%	11/15/2043	2,607	2,613,044	0.0
Series 2012-C6, Class E	5.31%	05/15/2045	5,000	3,699,086	0.0
Series 2012-C8, Class AS	3.42%	10/15/2045	1,500	1,532,252	0.0
Series 2012-C8, Class C	4.78%	10/15/2045	9,963	10,088,741	0.1
Series 2012-LC9, Class B	3.81%	12/15/2047	2,000	2,048,925	0.0
Series 2012-LC9, Class E	4.51%	12/15/2047	10,881	9,184,952	0.1
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,513	2,597,389	0.0
Series 2013-LC11, Class B	3.50%	04/15/2046	11,410	11,672,373	0.1
Series 2016-JP2, Class XA(f)	1.94%	08/15/2049	63,331	4,440,996	0.0
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C15, Class AS	4.42%	11/15/2045	11,115	11,860,369	0.1
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	9,170	9,793,448	0.1
Series 2014-C22, Class XA(f)	0.98%	09/15/2047	57,946	1,231,633	0.0
Series 2014-C24, Class B	4.12%	11/15/2047	1,355	1,417,164	0.0
Series 2014-C24, Class C	4.55%	11/15/2047	455	445,716	0.0
Series 2014-C26, Class C	4.52%	01/15/2048	4,926	5,130,409	0.0
JPMDB Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2017-C5, Class XA(f)	1.09%	03/15/2050	140,771	5,839,279	0.0
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(f)	1.59%	07/12/2050	44,580	2,558,153	0.0
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2013-C9, Class B	3.71%	05/15/2046	6,310	6,533,857	0.0
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	4,304	4,277,505	0.0
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2011-C3, Class C	5.46%	07/15/2049	5,000	4,994,473	0.0
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C1, Class D	5.74%	05/10/2045	10,900	10,375,409	0.1
Series 2017-C1, Class XA(f)	1.68%	06/15/2050	51,842	3,719,534	0.0
Series 2017-C2, Class XA(f)	1.20%	08/15/2050	47,560	2,260,672	0.0
Series 2017-C4, Class XA(f)	1.19%	10/15/2050	64,059	3,351,653	0.0
Series 2017-C6, Class XA(f)	1.15%	12/15/2050	42,683	2,158,884	0.0
Series 2018-C10, Class XA(f)	1.11%	05/15/2051	130,763	6,596,677	0.0
Series 2018-C15, Class XA(f)	1.09%	12/15/2051	106,939	5,799,127	0.0
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C4, Class XA(f)	1.73%	12/10/2045	3,209	38,409	0.0
Series 2013-C5, Class C	4.22%	03/10/2046	1,798	1,789,296	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.45%	04/10/2046	8,381	7,328,703	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-C28, Class B	4.23%	05/15/2048	2,802	3,031,475	0.0
Series 2015-LC20, Class C	4.06%	04/15/2050	7,415	7,739,978	0.1
Series 2015-LC20, Class XA(f)	1.45%	04/15/2050	33,696	1,060,782	0.0
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	5,156	5,615,708	0.0
Series 2016-C32, Class XA(f)	1.36%	01/15/2059	114,765	5,139,837	0.0
Series 2016-LC24, Class XA(f)	1.76%	10/15/2049	86,707	5,675,021	0.0
Series 2016-LC25, Class XA(f)	1.11%	12/15/2059	138,580	4,613,218	0.0
Series 2017-C38, Class XA(f)	1.16%	07/15/2050	36,340	1,654,507	0.0
Series 2018-C48, Class XA(f)	1.11%	01/15/2052	12,938	742,798	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	5.02%	06/15/2044	8,030	5,403,518	0.0
Series 2012-C7, Class AS	4.09%	06/15/2045	265	267,454	0.0
Series 2012-C7, Class XA(f)	1.45%	06/15/2045	7,521	26,281	0.0
Series 2012-C8, Class XA(f)	1.94%	08/15/2045	8,051	58,890	0.0
Series 2012-C9, Class E	4.97%	11/15/2045	5,000	4,427,561	0.0
Series 2013-C11, Class B	3.71%	03/15/2045	1,758	1,809,493	0.0
Series 2013-C14, Class B	3.84%	06/15/2046	360	371,210	0.0
Series 2014-C22, Class XA(f)	0.94%	09/15/2057	41,630	803,584	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	6,846	7,301,250	0.0
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	9,035	8,338,587	0.1
WFRBS Commercial Mortgage Trust, Series 2014-LC14, Class C	4.34%	03/15/2047	853	897,858	0.0
				384,420,448	1.6

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
NICHT STAATLICHE VARIABEL VERZINSLICHE CMBS					
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class D(d)	4.10%	05/15/2036	USD 9,789	\$ 7,061,853	0.0%
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(d) . . .	1.57%	11/15/2027	36,183	24,152,245	0.1
				<u>31,214,098</u>	<u>0.1</u>
STAATLICHE CMBS					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Multifamily Structured					
Pass-Through Certificates					
Series K072, Class A2	3.44%	12/25/2027	12,923	14,641,503	0.1
Series K073, Class A2	3.35%	01/25/2028	11,000	12,417,602	0.0
				<u>27,059,105</u>	<u>0.1</u>
				<u>442,693,651</u>	<u>1.8</u>
QUASI-STAATLICHE WERTPAPIERE					
QUASI-STAATSANLEIHEN					
BAHRAIN					
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.50%	10/25/2027	25,539	28,241,345	0.1
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	7.63%	11/07/2024	2,487	2,754,850	0.0
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The)	8.38%	11/07/2028	4,380	5,059,721	0.0
				<u>36,055,916</u>	<u>0.1</u>
CHILE					
Corp. Nacional del Cobre de Chile	3.75%	01/15/2031	5,181	5,701,690	0.0
INDONESIEN					
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	4.75%	05/15/2025	5,426	5,914,937	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.45%	05/15/2030	4,342	5,057,887	0.0
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT	5.71%	11/15/2023	1,065	1,168,372	0.0
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara	3.88%	07/17/2029	17,819	19,147,629	0.1
				<u>31,288,825</u>	<u>0.1</u>
KASACHSTAN					
KazMunayGas National Co. JSC	4.75%	04/24/2025	1,395	1,552,635	0.0
MALAYSIA					
Petronas Capital Ltd.	3.50%	04/21/2030	20,679	22,780,706	0.1
MEXIKO					
Petroleos Mexicanos	5.95%	01/28/2031	71,699	70,401,248	0.3
Petroleos Mexicanos	6.49%	01/23/2027	10,352	10,942,064	0.0
Petroleos Mexicanos	6.50%	01/23/2029	1,590	1,643,504	0.0
Petroleos Mexicanos	6.75%	09/21/2047	61,080	53,658,780	0.2
Petroleos Mexicanos	6.84%	01/23/2030	19,259	20,101,581	0.1
Petroleos Mexicanos	6.95%	01/28/2060	29,146	25,494,006	0.1
Petroleos Mexicanos	7.69%	01/23/2050	31,688	30,254,752	0.1
				<u>212,495,935</u>	<u>0.8</u>
PANAMA					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	4.00%	08/11/2041	9,964	10,208,741	0.1
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA	5.13%	08/11/2061	8,472	8,980,320	0.0
				<u>19,189,061</u>	<u>0.1</u>
SÜDAFRIKA					
Eskom Holdings SOC Ltd.	6.35%	08/10/2028	11,899	13,215,029	0.1
TRINIDAD & TOBAGO					
Trinidad Generation UnLtd.	5.25%	11/04/2027	16,768	17,218,640	0.1
UKRAINE					
State Agency Of Roads Of Ukraine	6.25%	06/24/2028	22,184	22,261,644	0.1
VEREINIGTE ARABISCHE EMIRATE					
DP World Salaam(c)	6.00%	10/01/2025	20,172	22,055,560	0.1
MDGH - GMTN BV, Series G	2.88%	05/21/2030	16,037	16,996,491	0.1
				<u>39,052,051</u>	<u>0.2</u>
				<u>420,812,132</u>	<u>1.7</u>
INDUSTRIE					
ENERGIE					
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC	7.63%	11/08/2026	14,994	15,395,090	0.1
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
DP World Crescent Ltd.	3.88%	07/18/2029	798	865,830	0.0
DP World Ltd./United Arab Emirates	5.63%	09/25/2048	3,267	4,100,085	0.0
				<u>4,965,915</u>	<u>0.0</u>
				<u>20,361,005</u>	<u>0.1</u>
				<u>441,173,137</u>	<u>1.8</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SCHWELLENMÄRKTE – STAATLICHE WERTPAPIERE					
BAHRAIN					
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	USD 16,444	\$ 16,115,120	0.1%
Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031	18,000	17,947,125	0.1
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	16,489	17,883,351	0.0
Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028	20,898	23,013,922	0.1
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	7,799	8,670,538	0.0
CBB International Sukuk Programme Co. WLL	4.50%	03/30/2027	3,414	3,581,073	0.0
CBB International Sukuk Programme Co. WLL	6.25%	11/14/2024	9,317	10,104,869	0.1
				<u>97,315,998</u>	<u>0.4</u>
OMAN					
Oman Government International Bond	4.75%	06/15/2026	47,000	48,668,500	0.2
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	60,335	63,117,952	0.2
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	17,194	18,698,475	0.1
Oman Government International Bond	6.50%	03/08/2047	5,000	5,005,625	0.0
				<u>135,490,552</u>	<u>0.5</u>
				<u>232,806,550</u>	<u>0.9</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO Ltd., Series 2020-9A, Class D(d)	3.83%	01/20/2034	4,250	4,279,023	0.0
AGL CLO Ltd., Series 2021-10A, Class D(d)	3.09%	04/15/2034	6,750	6,755,042	0.0
AGL CLO Ltd., Series 2021-11A, Class D(d)	3.31%	04/15/2034	4,750	4,754,389	0.0
Apidos CLO, Series 2021-35A, Class D(d)	2.85%	04/20/2034	6,000	6,002,610	0.0
Apidos CLO XXVI, Series 2017-26A, Class D(d)	6.23%	07/18/2029	5,450	5,302,529	0.0
Bain Capital Credit CLO Ltd., Series 2021-4A, Class D(d)	3.22%	10/20/2034	4,000	4,000,000	0.0
Ballyrock CLO 17 Ltd., Series 2021-17A, Class C(d)	3.17%	10/20/2034	13,950	13,950,000	0.1
Ballyrock CLO Ltd., Series 2020-14A, Class C(d)	3.73%	01/20/2034	8,330	8,360,605	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2016-1A, Class A2AR(d)	1.88%	04/26/2031	11,000	10,961,423	0.1
Black Diamond CLO Ltd., Series 2019-2A, Class B(d)	3.19%	07/23/2032	8,000	7,852,400	0.0
Dryden 49 Senior Loan Fund, Series 2017-49A, Class E(d)	6.43%	07/18/2030	4,717	4,701,617	0.0
Goldentree Loan Opportunities Ltd., Series 2015-11A, Class AR2(d)	1.20%	01/18/2031	600	600,286	0.0
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(d)	2.88%	10/20/2030	6,000	6,000,084	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2020-39A, Class D(d)	3.73%	01/20/2032	1,000	1,003,227	0.0
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd., Series 2021-43A, Class D(d)	3.21%	07/17/2035	11,050	11,057,801	0.1
New Mountain CLO Ltd., Series CLO-3A, Class D(d)	3.48%	10/20/2034	11,950	11,948,757	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd., Series 2018-1A, Class D(d)	5.33%	01/20/2031	2,750	2,611,502	0.0
Peace Park CLO Ltd., Series 2021-1A, Class D(d)	3.07%	10/20/2034	27,675	27,675,000	0.1
Pikes Peak CLO, Series 2021-8A, Class D(d)	3.25%	07/20/2034	4,000	4,000,456	0.0
Romark CLO III Ltd., Series 2019-3A, Class A2(d)	2.20%	07/15/2032	28,050	28,051,879	0.1
Venture CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(d)	4.13%	07/20/2030	17,169	17,174,157	0.1
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class A1R(d)	1.32%	10/18/2031	3,000	3,002,592	0.0
				<u>190,045,379</u>	<u>0.8</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025	8,756	9,034,221	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Melco Resorts Finance Ltd.	5.38%	12/04/2029	12,622	13,078,790	0.1
Melco Resorts Finance Ltd.	5.63%	07/17/2027	9,002	9,306,891	0.1
MGM China Holdings Ltd.	5.25%	06/18/2025	8,970	9,240,831	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.38%	05/15/2024	4,527	4,638,883	0.0
MGM China Holdings Ltd.	5.88%	05/15/2026	4,869	5,089,018	0.0
Studio City Finance Ltd.	5.00%	01/15/2029	30,884	30,339,669	0.1
Wynn Macau Ltd.	4.88%	10/01/2024	953	957,050	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.50%	01/15/2026	30,257	30,947,770	0.1
Wynn Macau Ltd.	5.50%	10/01/2027	4,203	4,255,538	0.0
Wynn Macau Ltd.	5.63%	08/26/2028	16,758	16,982,574	0.1
				<u>124,837,014</u>	<u>0.5</u>
ENERGIE					
Leviathan Bond Ltd.	5.75%	06/30/2023	16,779	17,489,815	0.1
Leviathan Bond Ltd.	6.13%	06/30/2025	5,318	5,791,956	0.0
Leviathan Bond Ltd.	6.50%	06/30/2027	12,964	14,304,770	0.0
				<u>37,586,541</u>	<u>0.1</u>
				<u>171,457,776</u>	<u>0.6</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
FINANZINSTITUTE					
VERSICHERUNGEN					
Highlands Holdings Bond Issuer Ltd./Highlands Holdings Bond Co-Issuer, Inc.(b)	7.63%	10/15/2025	USD 11,824	\$ 12,531,614	0.1%
				<u>183,989,390</u>	<u>0.7</u>
ABS-ANLEIHEN					
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC, Series 2019-2A, Class C	4.24%	09/22/2025	4,000	4,293,165	0.0
CPS Auto Receivables Trust					
Series 2016-B, Class E	8.14%	05/15/2023	2,000	2,004,563	0.0
Series 2016-C, Class E	8.39%	09/15/2023	7,842	7,860,657	0.1
CPS Auto Trust, Series 2017-A, Class E	7.07%	04/15/2024	6,800	6,943,093	0.0
Exeter Automobile Receivables Trust					
Series 2017-1A, Class D	6.20%	11/15/2023	9,131	9,188,412	0.1
Series 2017-3A, Class D	5.28%	10/15/2024	11,280	11,571,007	0.1
Series 2018-4A, Class E	5.38%	07/15/2025	13,125	13,749,726	0.1
First Investors Auto Owner Trust, Series 2018-1A, Class E	5.35%	07/15/2024	3,100	3,197,070	0.0
Flagship Credit Auto Trust					
Series 2016-4, Class E	6.44%	01/16/2024	3,435	3,441,885	0.0
Series 2017-1, Class E	6.46%	12/15/2023	6,260	6,358,262	0.0
Series 2018-3, Class D	4.15%	12/16/2024	2,550	2,674,050	0.0
Series 2019-1, Class E	5.06%	06/15/2026	5,339	5,593,117	0.0
Series 2019-2, Class E	4.52%	12/15/2026	5,677	5,986,210	0.0
Series 2019-3, Class E	3.84%	12/15/2026	5,230	5,442,408	0.0
				<u>88,303,625</u>	<u>0.4</u>
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
CLUB Credit Trust, Series 2017-P2, Class C	4.91%	01/15/2024	2,319	2,329,531	0.0
Consumer Loan Underlying Bond CLUB Credit Trust, Series 2019-P2, Class B	2.83%	10/15/2026	5,874	5,903,504	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust					
Series 2018-P1, Class C	5.21%	07/15/2025	8,362	8,484,192	0.0
Series 2018-P2, Class C	5.21%	10/15/2025	4,265	4,333,608	0.0
Marlette Funding Trust					
Series 2017-3A, Class D	5.03%	12/15/2024	1,192	1,197,337	0.0
Series 2018-1A, Class D	4.85%	03/15/2028	10,262	10,268,447	0.1
Series 2018-2A, Class C	4.37%	07/17/2028	1,739	1,745,050	0.0
Series 2018-3A, Class C	4.63%	09/15/2028	16,037	16,062,425	0.1
Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028	10,475	10,543,301	0.1
SoFi Consumer Loan Program LLC					
Series 2017-4, Class B	3.59%	05/26/2026	2,364	2,372,684	0.0
Series 2017-6, Class C	4.02%	11/25/2026	9,855	9,982,533	0.0
SoFi Consumer Loan Program Trust, Series 2018-2, Class C	4.25%	04/26/2027	6,200	6,350,046	0.0
				<u>79,572,658</u>	<u>0.3</u>
				<u>167,876,283</u>	<u>0.7</u>
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
ISRAEL					
Israel Government International Bond	2.75%	07/03/2030	43,932	47,283,155	0.2
KATAR					
Qatar Government International Bond	3.40%	04/16/2025	8,394	9,119,557	0.0
Qatar Government International Bond	3.75%	04/16/2030	16,175	18,437,478	0.1
				<u>27,557,035</u>	<u>0.1</u>
SAUDI-ARABIEN					
Saudi Government International Bond	2.90%	10/22/2025	16,949	18,126,956	0.0
Saudi Government International Bond	3.25%	10/26/2026	21,000	22,806,000	0.1
Saudi Government International Bond	3.25%	10/22/2030	17,883	19,423,173	0.1
				<u>60,356,129</u>	<u>0.2</u>
				<u>135,196,319</u>	<u>0.5</u>
GEMEINDEVERWALTUNG – US-KOMMUNALANLEIHEN					
VEREINIGTE STAATEN					
Public Fin Auth Wi Revenue, Series 2021	5.75%	07/25/2041	15,000	15,804,375	0.1
State of California, Series 2010	7.60%	11/01/2040	1,600	2,837,346	0.0
State of Illinois, Series 2010	7.35%	07/01/2035	7,675	10,006,708	0.0
				<u>28,648,429</u>	<u>0.1</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
VORZUGSAKTIEN					
FINANZINSTITUTE					
VERSICHERUNGEN					
Hartford Financial Services Group, Inc. (The)	7.88%		80,075	\$ 2,111,578	0.0%
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN					
OPTIONEN AUF AKTIENINDIZES					
SPX USISDA10					
Expiration: Nov 2021, Exercise Price: USD 99.00			13,714,335	394,040	0.0
SPX USISDA10					
Expiration: Nov 2021, Exercise Price: USD 99.00			13,714,335	665,461	0.0
				1,059,501	0.0
				24,367,007,293	98.0
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class D(d)	2.98%	07/20/2034	USD 6,000	5,979,936	0.0
Apidos CLO XXIII, Series 2015-23A, Class ER(d)	6.33%	04/15/2033	2,248	2,248,025	0.0
Bain Capital Credit CLO, Series 2019-2A, Class C(d)	2.88%	10/17/2032	4,750	4,755,956	0.0
Ballyrock CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class C(d)	3.03%	07/20/2034	3,000	3,000,330	0.0
CBAM Ltd., Series 2018-7A, Class B1(d)	1.73%	07/20/2031	7,726	7,726,711	0.0
CIFC Funding Ltd., Series 2017-3A, Class A1(d)	1.35%	07/20/2030	560	560,293	0.0
Dryden CLO Ltd., Series 2018-57A, Class A(d)	1.13%	05/15/2031	25,195	25,214,073	0.1
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(d)	3.18%	07/15/2030	1,500	1,499,070	0.0
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A, Class A1(d)	1.16%	04/26/2031	22,100	22,106,475	0.1
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd., Series 2018-1A, Class A2(d)	1.93%	07/21/2031	7,424	7,424,290	0.0
ICG US CLO Ltd., Series 2015-1A, Class CR(d)	3.23%	10/19/2028	2,500	2,494,728	0.0
Invesco CLO Ltd., Series 2021-1A, Class D(d)	3.22%	04/15/2034	8,000	8,000,920	0.0
Neuberger Berman Loan Advisors CLO 33 Ltd., Series 2019-33A, Class C(d)	2.58%	10/16/2032	12,500	12,507,187	0.1
Neuberger Berman Loan Advisors CLO 42 Ltd., Series 2021-42A, Class D(d)	2.94%	07/16/2035	4,000	3,954,084	0.0
Northwoods Capital Ltd., Series 2018-12BA, Class B(d)	1.97%	06/15/2031	5,400	5,291,411	0.0
OCP CLO Ltd., Series 2017-13A, Class A1A(d)	1.39%	07/15/2030	25,000	25,000,000	0.1
Octagon Investment Partners 38 Ltd., Series 2018-1A, Class B(d)	2.08%	07/20/2030	3,900	3,893,031	0.0
OZLM Ltd., Series 2014-7RA, Class BR(d)	2.33%	07/17/2029	9,000	9,001,233	0.1
OZLM Ltd., Series 2014-7RA, Class CR(d)	3.13%	07/17/2029	10,500	10,333,323	0.1
OZLM Ltd., Series 2018-18A, Class B(d)	1.68%	04/15/2031	3,000	2,998,416	0.0
OZLM XVIII Ltd., Series 2018-18A, Class A(d)	1.15%	04/15/2031	9,625	9,625,934	0.1
Romark CLO III Ltd., Series 2019-3A, Class B(d)	2.93%	07/15/2032	3,500	3,501,393	0.0
Sound Point CLO XIX Ltd., Series 2018-1A, Class A(d)	1.13%	04/15/2031	34,104	34,120,131	0.2
Southwick Park CLO LLC, Series 2019-4A, Class A1(d)	1.43%	07/20/2032	4,540	4,541,244	0.0
THL Credit Wind River CLO Ltd., Series 2017-4A, Class A(d)	1.28%	11/20/2030	6,898	6,898,481	0.0
TICP CLO IX Ltd., Series 2017-9A, Class B(d)	1.73%	01/20/2031	1,550	1,551,220	0.0
Venture CLO Ltd., Series 2017-29A, Class C(d)	2.62%	09/07/2030	2,300	2,289,388	0.0
Vibrant CLO XI Ltd., Series 2019-11A, Class B(d)	2.73%	07/20/2032	3,000	3,000,087	0.0
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class BR(d)	2.33%	10/18/2031	10,000	9,945,470	0.1
				239,462,840	1.0
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Hyundai Capital America	5.88%	04/07/2025	79,779	91,909,159	0.4
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
ABN AMRO Bank NV	7.75%	05/15/2023	7,651	8,446,639	0.0
VERSICHERUNGEN					
Nationwide Mutual Insurance Co.(d)	2.41%	12/15/2024	1,000	1,005,923	0.0
				9,452,562	0.0
				101,361,721	0.4
STAMMAKTIEN					
Mt. Logan Re Ltd. (Series 1) (Preference Shares)(g)	0.00%		68,787	70,116,171	0.3
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Grantor Trust CGCMT, Series 2015-GC17(g)	4.49%	09/15/2048	USD 105	4,734,558	0.0
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(g)	0.00%	03/10/2047	143	4,675,191	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(g)	4.00%	04/15/2050	207	5,387,098	0.0
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(g)	4.00%	11/15/2047	222	4,875,378	0.0
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(g)	3.40%	10/15/2057	125	3,322,933	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	USD 3,699	\$ 1,895,653	0.0%
Series 2013-GC13, Class E(g)	3.49%	07/10/2046	231	9,591,052	0.2
Series 2013-GC13, Class F(g)	3.49%	07/10/2046	80	3,609,941	0.0
WF-RBS Commercial Mortgage Trust,					
Series 2012-C7, Class E	4.96%	06/15/2045	8,500	1,615,000	0.0
				<u>39,706,804</u>	<u>0.2</u>
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
JPMorgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2015-CH1, Class M2(d)	5.58%	10/25/2025	653	618,964	0.0
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R, Class A(d)	2.44%	02/27/2023	21,458	21,433,809	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust,					
Series 2015-WF1, Class 1M2(d)	5.33%	11/25/2025	745	721,224	0.0
				<u>22,773,997</u>	<u>0.1</u>
SCHWELLENMÄRKTE – HARTE WÄHRUNG					
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
Tetraform Global Operating LLC	6.13%	03/01/2026	7,314	7,527,494	0.0
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Tonon Luxembourg SA(b) (g) (h)	6.50%	10/31/2024	4,577	46,232	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(i)	10.50%	01/28/2018	3,700	37,000	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(h)	11.75%	02/09/2022	31,238	156,190	0.0
				<u>239,422</u>	<u>0.0</u>
INVESTITIONSGÜTER					
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	19,218	96,089	0.0
				<u>335,511</u>	<u>0.0</u>
				<u>7,863,005</u>	<u>0.0</u>
				<u>481,284,538</u>	<u>2.0</u>
Gesamtanlagen				<u>\$ 24,848,291,831</u>	<u>100.0%</u>
(Kosten \$24,784,218,244)					
Termineinlagen					
ANZ, London(j)	(0.13)%	–		28,065	0.0
BBH, Grand Cayman(j)	4.00%	–		94,512	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	0.01%	–		102,915	0.0
BNP Paribas, Paris(j)	0.01%	–		5,494	0.0
Citibank, New York(j)	0.01%	–		705,108,878	2.9
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(j)	0.00%	–		289,441	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(j)	0.01%	–		12,022	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(j)	(0.78)%	–		96,430	0.0
Sumitomo, London(j)	(0.28)%	–		75	0.0
Sumitomo, London(j)	0.01%	–		40,157	0.0
Termineinlagen insgesamt				<u>705,777,989</u>	<u>2.9</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(716,630,281)</u>	<u>(2.9)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 24,837,439,539</u>	<u>100.0%</u>

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
U.S. Long Bond (CBT) Futures	12/21/2021	2,606	\$ 423,515,500	\$ 424,696,564	\$ 1,181,064
U.S. Ultra Bond (CBT) Futures	12/21/2021	2,813	553,104,750	554,952,156	1,847,406
U.S. T-Note 5 Yr (CBT) Futures	12/31/2021	4,488	554,667,688	555,249,750	582,062
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures	12/21/2021	4,435	590,028,242	591,864,609	1,836,367
Short					
U.S. 10 Yr Ultra Futures	12/21/2021	8,131	1,197,528,109	1,203,515,047	(5,986,938)
U.S. T-Note 2 Yr (CBT) Futures	12/31/2021	1,564	344,361,031	344,593,189	(232,158)
U.S. T-Note 10 Yr (CBT) Futures+	12/21/2021	77	10,244,321	10,275,891	(31,570)
					<u>\$ (803,767)</u>
				Wertsteigerung	\$ 5,446,899
				Wertminderung	\$ (6,250,666)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 763,513	AUD 1,040,841	09/08/2021	\$ (2,063,326)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 136,338	CAD 171,584	09/08/2021	(339,840)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 77,439	CNH 506,371	09/08/2021	1,011,107
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 234,498	GBP 169,046	09/08/2021	(2,083,609)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 658,807	AUD 892,367	09/13/2021	(5,956,058)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 136,337	CAD 170,474	09/13/2021	(1,220,032)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 77,772	CNH 505,968	09/13/2021	576,067
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 138,839	EUR 118,177	09/13/2021	728,523
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 234,497	GBP 169,126	09/13/2021	(1,968,638)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 32,014	PLN 124,950	09/13/2021	609,422
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 211,339	SGD 286,538	09/13/2021	1,780,993
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 133	ZAR 1,932	09/13/2021	(187)
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 66,409	ZAR 978,353	09/13/2021	839,471
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 76,923	CAD 97,691	10/01/2021	504,433
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 20,405	CHF 18,740	10/01/2021	75,086
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 133,131	EUR 113,319	10/01/2021	752,155
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 33,405	JPY 3,681,887	10/01/2021	71,424
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 146,791	NZD 211,485	10/01/2021	2,231,328
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 182,265	SGD 246,420	10/01/2021	1,012,254
Brown Brothers Harriman & Co.+.....	USD 91,143	ZAR 1,364,914	10/01/2021	2,440,904
				<u>\$ (998,523)</u>
			Wertsteigerung	\$ 12,633,167
			Wertminderung	\$ (13,631,690)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

VERKAUFTE ZINS-SWAPTIONS

Bezeichnung	Ausübungs- preis	Fälligkeit	Nominalbetrag (000)	Prämien erhalten	Marktwert
Put - OTC - 1 Year Interest Rate Swap	1.16%	09/07/21	USD 262,637	\$ 2,403,129	\$ (4,049,108)
Put - OTC - 1 Year Interest Rate Swap	1.26%	09/20/21	USD 392,800	3,201,320	(3,903,089)
				<u>\$ 5,604,449</u>	<u>\$ (7,952,197)</u>

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte					
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	USD 5,000	\$ (498,500)	\$ (423,684)
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 34, 5 Year Index	06/20/2025	145,045	13,393,158	7,096,357
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 36, 5 Year Index	06/20/2026	1,479,841	145,145,943	15,879,128
Citigroup Global Markets, Inc./(INTRCONX)	Russian Federation	06/20/2026	24,264	236,723	370,786
Goldman Sachs International/(INTRCONX)	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(498,500)	(423,684)
Insgesamt				<u>\$ 157,778,824</u>	<u>\$ 22,498,90</u>
				Wertsteigerung	\$ 23,346,271
				Wertminderung	\$ (847,368)

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	USD 453,010	04/20/2023	2.850%	3 Month LIBOR	\$ (19,348,374)
Citigroup Global Markets, Inc./(CME Group)	58,460	06/28/2026	1.460%	3 Month LIBOR	(1,721,242)
Insgesamt					<u>\$ (21,069,616)</u>

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 4,831	\$ (2,135,571)	\$ (93,468)	\$ (2,042,103)
Barclays Bank PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(383,312)	(6,459,188)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	20,000	(1,994,000)	(391,205)	(1,602,795)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(997,000)	(175,149)	(821,851)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(997,000)	(189,562)	(807,438)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	500	(49,850)	288	(50,138)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(93,524)	(2,042,047)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(95,780)	(2,039,791)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(102,684)	(2,032,887)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(102,684)	(2,032,887)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	7,729	(3,416,914)	(1,461,058)	(1,955,856)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,509	(1,993,342)	(532,148)	(1,461,194)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(705,564)	(1,430,007)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(778,397)	(1,357,174)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(801,498)	(1,334,073)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	50,000	(13,685,000)	(3,283,590)	(10,401,410)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	50,000	(13,685,000)	(4,626,985)	(9,058,015)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(467,871)	(6,374,629)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	30,000	(8,211,000)	(2,451,029)	(5,759,971)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(1,650,619)	(5,191,881)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(2,144,874)	(4,697,626)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(2,313,488)	(4,529,012)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(2,313,492)	(4,529,008)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	18,067	(4,944,938)	(1,119,029)	(3,825,909)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(5,474,000)	(1,830,489)	(3,643,511)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,337	(5,292,537)	(1,656,496)	(3,636,041)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(5,474,000)	(1,842,630)	(3,631,370)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(4,105,500)	(1,212,179)	(2,893,321)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(4,105,500)	(1,367,529)	(2,737,971)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(595,802)	(2,141,198)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(619,377)	(2,117,623)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	9,689	(2,651,879)	(590,919)	(2,060,960)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(4,105,500)	(2,111,586)	(1,993,914)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(848,465)	(1,888,535)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(936,328)	(1,800,672)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(991,722)	(1,745,278)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,003,827)	(1,733,173)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,006,371)	(1,730,629)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	8,663	(2,371,063)	(754,164)	(1,616,899)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,000	(1,642,200)	(487,401)	(1,154,799)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(302,219)	(1,066,281)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(429,271)	(939,229)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	1,933	(529,062)	(119,726)	(409,336)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,000	(547,400)	(198,808)	(348,592)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	840	(229,908)	(109,581)	(120,327)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	311	(85,121)	(18,968)	(66,153)
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(1,488,338)	119,838
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(1,597,749)	229,249
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(3,001,068)	264,068
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(3,025,078)	288,078
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,143	(1,389,403)	(573,306)	(816,097)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,143	(1,389,403)	(585,280)	(804,123)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,143	(1,389,403)	(588,046)	(801,357)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,571	(694,488)	(291,615)	(402,873)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	34,700	(9,497,390)	(2,106,146)	(7,391,244)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(985,032)	(1,751,968)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	16,698	(4,570,244)	(3,999,086)	(571,158)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,524	(3,427,819)	(2,999,434)	(428,385)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,524	(3,427,820)	(3,029,730)	(398,090)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,679	(1,828,042)	(1,745,447)	(82,595)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	366	(100,174)	(44,221)	(55,953)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	257	(70,341)	(31,168)	(39,173)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,100	(1,006,970)	(102,609)	(904,361)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	12,387	(1,234,984)	(475,256)	(759,728)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,955	(494,014)	(193,716)	(300,298)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,853	(483,844)	(189,903)	(293,941)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	4,465	(445,161)	(168,762)	(276,399)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	3,640	(362,908)	(144,462)	(218,446)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,477	(246,957)	(95,036)	(151,921)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 9,661	\$ (4,271,143)	\$ (191,559)	\$ (4,079,584)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,178	(4,057,586)	(868,708)	(3,188,878)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(88,905)	(2,046,666)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,347	(1,922,014)	(396,638)	(1,525,376)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	34,200	(9,360,540)	(684,865)	(8,675,675)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(942,469)	(5,900,031)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(5,474,000)	(1,581,335)	(3,892,665)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(53,312)	(2,683,688)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,544	(3,159,593)	(635,340)	(2,524,253)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(519,952)	(2,217,048)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(524,695)	(2,212,305)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,600	(2,080,120)	(298,629)	(1,781,491)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,250,983)	(1,486,017)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,614	(1,810,252)	(526,420)	(1,283,832)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,340	(640,458)	(29,558)	(610,900)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(498,500)	(188,390)	(310,110)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	19,426	(5,316,896)	(1,385,170)	(3,931,726)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(761,268)	(1,975,732)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,159	(1,138,318)	(286,754)	(851,564)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,082	(1,117,243)	(416,536)	(700,707)
Deutsche Bank AG	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	318	(87,037)	(32,449)	(54,588)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(498,500)	(97,801)	(400,699)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	2,500	(249,250)	1,440	(250,690)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	79,704	(35,236,927)	(14,830,444)	(20,406,483)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,158	(1,396,237)	(597,517)	(798,720)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	234,658	(64,225,895)	(25,349,299)	(38,876,596)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	98,466	(26,950,144)	(11,585,464)	(15,364,680)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(5,474,000)	(1,257,483)	(4,216,517)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	20,000	(5,474,000)	(2,677,104)	(2,796,896)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,154	(3,052,850)	(788,670)	(2,264,180)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	11,300	(3,092,810)	(1,195,097)	(1,897,713)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,369,368)	(1,367,632)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	4,290	(1,174,173)	(300,537)	(873,636)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(669,276)	(699,224)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(693,916)	(674,584)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	25,000	(2,492,500)	(876,982)	(1,615,518)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	8,283	(825,815)	(172,604)	(653,211)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(997,000)	(369,642)	(627,358)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(997,000)	(408,856)	(588,144)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(498,500)	(46,295)	(452,205)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(498,500)	(52,413)	(446,087)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	7,042	(702,087)	(272,948)	(429,139)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	5,000	(498,500)	(104,988)	(393,512)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,661	(4,271,143)	(1,707,235)	(2,563,908)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	6,763	(2,989,800)	(873,295)	(2,116,505)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(709,949)	(1,425,622)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(714,284)	(1,421,287)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	50,000	(13,685,000)	(4,150,800)	(9,534,200)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	50,000	(13,685,000)	(4,497,603)	(9,187,397)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	30,000	(8,211,000)	(2,574,439)	(5,636,561)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(2,282,029)	(4,560,471)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	25,000	(6,842,500)	(3,327,217)	(3,515,283)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(4,105,500)	(908,412)	(3,197,088)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	12,870	(3,522,519)	(883,709)	(2,638,810)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,019,967)	(1,717,033)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,213,093)	(1,523,907)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,491,114)	(1,245,886)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,500,009)	(1,236,991)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,503,494)	(1,233,506)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(1,525,991)	(1,211,009)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,500	(1,779,050)	(700,579)	(1,078,471)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,972	(1,908,236)	(877,739)	(1,030,497)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(432,700)	(935,800)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,452	(1,765,912)	(841,683)	(924,229)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(469,986)	(898,514)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(497,020)	(871,480)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(504,500)	(864,000)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(537,615)	(830,885)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(538,261)	(830,239)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(560,743)	(807,757)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(659,598)	(708,902)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(751,747)	(616,753)
JP Morgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,500	(957,950)	(375,425)	(582,525)

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 12,539	\$ (5,543,516)	\$ (2,291,277)	\$ (3,252,239)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	12,047	(5,326,115)	(2,216,038)	(3,110,077)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,136	(1,386,413)	(581,692)	(804,721)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	3,136	(1,386,413)	(584,017)	(802,396)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,944	(859,354)	(365,141)	(494,213)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	361	(159,741)	(68,305)	(91,436)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	10,000	(997,000)	(189,562)	(807,438)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.A Series 6	05/11/2063	325	(32,436)	(12,934)	(19,502)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,661	(4,271,143)	(182,285)	(4,088,858)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	9,661	(4,271,143)	(186,755)	(4,084,388)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(81,685)	(2,053,886)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(86,611)	(2,048,960)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	4,831	(2,135,571)	(91,048)	(2,044,523)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,254	(996,458)	(267,707)	(728,751)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	15,000	(4,105,500)	(205,719)	(3,899,781)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(131,915)	(2,605,085)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(152,817)	(2,584,183)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	6,529	(1,786,987)	(442,468)	(1,344,519)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	7,700	(2,107,490)	(995,149)	(1,112,341)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	5,000	(1,368,500)	(693,916)	(674,584)
Morgan Stanley Capital Services LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	10,000	(2,737,000)	(106,392)	(2,630,608)
Insgesamt				<u>\$ (585,827,780)</u>	<u>\$ (196,713,936)</u>	<u>\$ (389,113,844)</u>
					Wertsteigerung	\$ 901,233
					Wertminderung	\$ (390,015,077)

INFLATIONS-SWAPS (VPI)

Gegenpartei	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Deutsche Bank AG	USD 65,000	01/15/2026	1.578%	CPI#	\$ 7,316,745
Swaps insgesamt					<u>\$ (380,367,812)</u>

Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.

- (a) Die Position oder ein Teil der Position wurde gesondert verwahrt, um als Sicherheit für offene OTC-Derivate zu dienen.
- (b) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (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. August 2021.
- (e) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (f) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (g) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (h) Not leidend.
- (i) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (j) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

USD – United States Dollar

ZAR – South African Rand

Glossar:

ABS – Asset-Backed Securities

CBT – Chicago Board of Trade

CDX-CMBX.NA – North American Commercial Mortgage-Backed Index

CDX-NAHY – North American High Yield Credit Default Swap Index

CLO – Collateralized Loan Obligations

CMBS – Commercial Mortgage-Backed Securities

CME – Chicago Mercantile Exchange

CPI – Consumer Price Index

INTRCONX – Inter-Continental Exchange

JSC – Joint Stock Company

LIBOR – London Interbank Offered Rate

REIT – Real Estate Investment Trust

REMICs – Real Estate Mortgage Investment Conduits

TBA – To Be Announced

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Axalta Coating Systems Dutch Holding B BV	3.75%	01/15/2025	EUR 3,149	€ 3,204,095	0.1%
Chemours Co. (The)	4.00%	05/15/2026	8,875	9,085,781	0.4
Guala Closures SpA	3.25%	06/15/2028	1,000	1,001,490	0.1
INEOS Group Holdings SA	5.38%	08/01/2024	6,530	6,535,317	0.3
INEOS Quattro Finance 1 PLC	3.75%	07/15/2026	5,128	5,285,689	0.2
Kleopatra Finco SARL	4.25%	03/01/2026	7,650	7,628,039	0.3
Kraton Polymers LLC/Kraton Polymers Capital Corp.	5.25%	05/15/2026	17,075	17,529,906	0.8
Kronos International, Inc.	3.75%	09/15/2025	7,448	7,578,340	0.3
LANXESS AG	4.50%	12/06/2076	6,207	6,611,279	0.3
OCI NV	3.63%	10/15/2025	9,551	9,943,441	0.5
Schoeller Packaging BV	6.38%	11/01/2024	7,446	7,722,674	0.4
Sealed Air Corp.	4.50%	09/15/2023	6,910	7,440,086	0.3
SGL Carbon SE	4.63%	09/30/2024	9,315	9,481,874	0.4
Solvay Finance SAC(A)	5.87%	06/03/2024	8,000	9,030,223	0.4
Solvay SA(a)	4.25%	12/04/2023	4,000	4,286,969	0.2
Synthomer PLC	3.88%	07/01/2025	1,344	1,398,717	0.1
				<u>113,763,920</u>	<u>5.1</u>
INVESTITIONSGÜTER					
ARD Finance SA(b)	5.00%	06/30/2027	17,200	17,724,040	0.8
Ardagh Metal Packaging Finance USA LLC/Ardagh Metal Packaging Finance PLC	3.00%	09/01/2029	5,591	5,597,989	0.3
Ellaktor Value PLC	6.38%	12/15/2024	6,914	6,880,641	0.3
IMA Industria Macchine Automatiche SpA	3.75%	01/15/2028	2,100	2,116,770	0.1
Mauser Packaging Solutions Holding Co.	4.75%	04/15/2024	21,627	21,641,994	1.0
Paprec Holding SA	4.00%	03/31/2025	10,544	10,729,149	0.5
PCF GmbH	4.75%	04/15/2026	3,100	3,205,467	0.2
Renk AG/Frankfurt am Main	5.75%	07/15/2025	11,278	11,807,709	0.5
Rolls-Royce PLC	4.63%	02/16/2026	2,880	3,162,029	0.1
Sarens Finance Co. NV	5.75%	02/21/2027	3,125	3,138,282	0.1
Titan Holdings II BV	5.13%	07/15/2029	11,000	11,192,518	0.5
TK Elevator Midco GmbH	4.38%	07/15/2027	5,098	5,353,673	0.2
Trivium Packaging Finance BV	3.75%	08/15/2026	11,064	11,286,859	0.5
Vertical Holdco GmbH	6.63%	07/15/2028	2,836	3,038,494	0.1
				<u>116,875,614</u>	<u>5.2</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN					
Altice Financing SA	3.00%	01/15/2028	12,145	11,571,612	0.5
Altice Finco SA	4.75%	01/15/2028	6,500	6,321,250	0.3
Banjay Entertainment SASU	3.50%	03/01/2025	8,458	8,565,823	0.4
Summer BC Holdco A SARL	9.25%	10/31/2027	4,776	5,183,363	0.2
Summer BC Holdco B SARL	5.75%	10/31/2026	7,385	7,736,846	0.3
UPCB Finance VII Ltd.	3.63%	06/15/2029	8,300	8,517,875	0.4
Virgin Media Secured Finance PLC	5.00%	04/15/2027	8,830	10,698,834	0.5
Virgin Media Vendor Financing Notes III DAC	4.88%	07/15/2028	9,199	10,903,505	0.5
Ziggo Bond Co. BV	3.38%	02/28/2030	EUR 5,350	5,329,035	0.2
				<u>74,828,143</u>	<u>3.3</u>
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Altice France Holding SA	8.00%	05/15/2027	6,000	6,416,638	0.3
Altice France SA/France	5.88%	02/01/2027	4,635	4,882,815	0.2
Arqiva Broadcast Finance PLC	6.75%	09/30/2023	GBP 5,834	6,939,980	0.3
eircom Finance DAC	3.50%	05/15/2026	EUR 3,016	3,090,766	0.1
Matterhorn Telecom SA	4.00%	11/15/2027	1,000	1,028,689	0.0
Telecom Italia SpA/Milano, Series E	3.63%	05/25/2026	2,778	3,083,355	0.1
Telecom Italia SpA/Milano, Series E	4.00%	04/11/2024	5,881	6,314,605	0.3
Telefonica Europe BV(a)	4.38%	12/14/2024	9,400	10,241,712	0.5
Telefonica Europe BV(a)	5.88%	03/31/2024	7,100	7,915,499	0.3
United Group BV	4.00%	11/15/2027	3,540	3,487,511	0.2
United Group BV	4.88%	07/01/2024	4,990	5,043,648	0.2
Vmed O2 UK Financing I PLC	4.00%	01/31/2029	GBP 8,900	10,360,112	0.5
Vodafone Group PLC	4.88%	10/03/2078	6,800	8,585,632	0.4
				<u>77,390,962</u>	<u>3.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
Adient Global Holdings Ltd.	3.50%	08/15/2024	EUR 3,030	3,094,222	0.1
Clarios Global LP/Clarios US Finance Co.	4.38%	05/15/2026	12,694	13,138,725	0.6
Dana Financing Luxembourg SARL	3.00%	07/15/2029	2,818	2,911,844	0.1
Faurecia SE	3.13%	06/15/2026	4,056	4,174,394	0.2
Ford Motor Credit Co. LLC, Series E	4.54%	03/06/2025	GBP 6,650	8,339,427	0.4

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Gestamp Automocion SA	3.25%	04/30/2026	EUR 3,086	€ 3,130,533	0.1%
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.63%	05/15/2025	9,861	10,042,272	0.5
IHO Verwaltungs GmbH(b)	3.75%	09/15/2026	6,498	6,628,595	0.3
Jaguar Land Rover Automotive PLC	4.50%	07/15/2028	1,951	1,963,609	0.1
Jaguar Land Rover Automotive PLC	5.88%	11/15/2024	3,971	4,313,344	0.2
Jaguar Land Rover Automotive PLC	6.88%	11/15/2026	4,070	4,670,325	0.2
Schaeffler AG, Series E	3.38%	10/12/2028	2,900	3,303,099	0.2
TI Automotive Finance PLC	3.75%	04/15/2029	7,402	7,600,715	0.3
ZF Finance GmbH, Series E	3.75%	09/21/2028	2,000	2,217,476	0.1
				<u>75,528,580</u>	<u>3.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	7.63%	03/01/2026	1,000	1,075,472	0.1
CPUK Finance Ltd.	4.88%	08/28/2025	GBP 3,550	4,172,355	0.2
Explorer II AS	3.38%	02/24/2025	EUR 3,470	3,283,218	0.1
TUI Cruises GmbH	6.50%	05/15/2026	3,110	3,179,637	0.1
				<u>11,710,682</u>	<u>0.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Cirsa Finance International SARL	4.75%	05/22/2025	500	498,503	0.0
Cirsa Finance International SARL	6.25%	12/20/2023	2,800	2,832,086	0.1
International Game Technology PLC	3.50%	07/15/2024	7,693	8,098,304	0.4
International Game Technology PLC	3.50%	06/15/2026	5,130	5,259,535	0.3
LHMC Finco 2 SARL(b)	7.25%	10/02/2025	6,918	6,846,571	0.3
Scientific Games International, Inc.	3.38%	02/15/2026	9,600	9,633,337	0.4
				<u>33,168,336</u>	<u>1.5</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – RESTAURANTS					
Stonegate Pub Co Financing 2019 PLC	8.00%	07/13/2025	GBP 4,430	5,332,943	0.2
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
BK LC Lux Finco1 SARL	5.25%	04/30/2029	EUR 6,310	6,548,840	0.3
Constellation Automotive Financing PLC	4.88%	07/15/2027	GBP 2,462	2,863,137	0.1
eG Global Finance PLC	4.38%	02/07/2025	EUR 3,724	3,674,872	0.2
Marks & Spencer PLC	4.50%	07/10/2027	GBP 5,100	6,412,347	0.3
				<u>19,499,196</u>	<u>0.9</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Boparan Finance PLC	7.63%	11/30/2025	2,349	2,428,544	0.1
Cab Selas	3.38%	02/01/2028	EUR 1,000	1,008,905	0.0
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	3.50%	02/11/2027	11,398	11,535,994	0.5
Cheplapharm Arzneimittel GmbH	4.38%	01/15/2028	3,897	4,057,428	0.2
Chrome Bidco SASU	3.50%	05/31/2028	1,000	1,020,573	0.0
Chrome Holdco Sasu	5.00%	05/31/2029	4,300	4,396,189	0.2
Cidron Aida Finco SARL	5.00%	04/01/2028	8,344	8,429,066	0.4
Gruenthal GmbH	4.13%	05/15/2028	5,378	5,552,643	0.2
Internationale Design Group SpA	6.50%	11/15/2025	1,035	1,075,975	0.1
Laboratoire Eimer Selas	5.00%	02/01/2029	2,131	2,196,424	0.1
Nidda BondCo GmbH	7.25%	09/30/2025	3,860	3,942,286	0.2
Nobel Bidco BV	3.13%	06/15/2028	3,499	3,482,461	0.2
Nomad Foods Bondco PLC	2.50%	06/24/2028	3,252	3,313,473	0.1
Organon & Co./Organon Foreign Debt Co-Issuer BV	2.88%	04/30/2028	7,250	7,399,160	0.3
Paysafe Finance PLC/Paysafe Holdings US Corp.	3.00%	06/15/2029	11,500	11,183,750	0.5
Picard Bondco SA	5.38%	07/01/2027	2,223	2,254,976	0.1
Rossini SARL	6.75%	10/30/2025	3,780	3,940,998	0.2
Sigma Holdco BV	5.75%	05/15/2026	4,513	4,353,830	0.2
Spectrum Brands, Inc.	4.00%	10/01/2026	4,289	4,375,108	0.2
				<u>85,947,783</u>	<u>3.8</u>
ENERGIE					
Rubis Terminal Infra SAS	5.63%	05/15/2025	7,113	7,486,599	0.4
UGI International LLC	3.25%	11/01/2025	9,342	9,529,504	0.4
				<u>17,016,103</u>	<u>0.8</u>
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Belden, Inc.	3.38%	07/15/2027	12,871	13,246,279	0.6
Parts Europe SA	6.50%	07/16/2025	6,945	7,293,557	0.3
ProGroup AG	3.00%	03/31/2026	7,449	7,554,448	0.4
Stena International SA	3.75%	02/01/2025	4,441	4,427,156	0.2
				<u>32,521,440</u>	<u>1.5</u>
DIENTSTLEISTUNGEN					
Allied Universal Holdco LLC/Allied Universal Finance Corp./Atlas Luxco 4 SARL	4.88%	06/01/2028	GBP 6,524	7,529,105	0.3
APCOA Parking Holdings GmbH	4.63%	01/15/2027	EUR 5,135	5,220,927	0.2
eDreams ODIGEO SA	5.50%	09/01/2023	8,306	8,241,007	0.4
Elior Group SA	3.75%	07/15/2026	4,282	4,432,816	0.2
Intertrust Group BV	3.38%	11/15/2025	18,270	18,622,009	0.8

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
Techem Verwaltungsgesellschaft 674 mbH	6.00%	07/30/2026	EUR 3,793	€ 3,909,389	0.2%
Verisure Midholding AB	5.25%	02/15/2029	6,733	6,934,990	0.3
				<u>54,890,243</u>	<u>2.4</u>
TECHNOLOGIE					
Boxer Parent Co., Inc.	6.50%	10/02/2025	6,856	7,201,202	0.3
Brunello Bidco SpA	3.50%	02/15/2028	3,307	3,306,337	0.2
Playtech PLC	4.25%	03/07/2026	5,253	5,384,218	0.2
				<u>15,891,757</u>	<u>0.7</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Avis Budget Finance PLC	4.13%	11/15/2024	2,559	2,610,631	0.1
Avis Budget Finance PLC	4.50%	05/15/2025	1,611	1,643,218	0.1
Avis Budget Finance PLC	4.75%	01/30/2026	5,728	5,849,596	0.3
CMA CGM SA	5.25%	01/15/2025	5,900	6,005,895	0.3
CMA CGM SA	7.50%	01/15/2026	5,000	5,573,903	0.3
Gatwick Airport Finance PLC	4.38%	04/07/2026	5,600	6,575,530	0.3
Kapla Holding SAS	3.38%	12/15/2026	EUR 2,722	2,704,369	0.1
Loxam SAS	3.75%	07/15/2026	3,237	3,318,080	0.1
Loxam SAS	6.00%	04/15/2025	9,851	10,013,136	0.4
				<u>44,294,358</u>	<u>2.0</u>
				<u>778,660,060</u>	<u>34.7</u>
FINANZINSTITUTE					
BANKWESEN					
Abanca Corp. Bancaria SA(a)	6.00%	01/20/2026	5,600	6,013,665	0.3
Banco Bilbao Vizcaya Argentaria SA(a)	5.88%	05/24/2022	6,200	6,408,266	0.3
Banco de Credito Social Cooperativo SA, Series E	5.25%	11/27/2031	2,200	2,293,168	0.1
Banco de Sabadell SA, Series E	5.63%	05/06/2026	7,100	8,325,600	0.4
Bank of Ireland, Series E	10.00%	12/19/2022	6,205	6,990,503	0.3
Bank of Ireland Group PLC(a)	7.50%	05/19/2025	5,500	6,503,568	0.3
Bankinter SA(a)	6.25%	01/17/2026	3,800	4,338,337	0.2
CaixaBank SA(a)	5.88%	10/09/2027	4,600	5,364,750	0.2
CaixaBank SA(a)	6.75%	06/13/2024	9,800	11,074,000	0.5
Commerzbank AG(a)	6.13%	10/09/2025	4,000	4,399,033	0.2
Intesa Sanpaolo SpA, Series E	6.63%	09/13/2023	9,295	10,461,217	0.4
				<u>72,172,107</u>	<u>3.2</u>
FINANZEN					
Lincoln Financing SARL	3.63%	04/01/2024	20,522	20,718,061	0.9
VERSICHERUNGEN					
Intesa Sanpaolo Vita SpA(a)	4.75%	12/17/2024	1,700	1,878,608	0.1
UnipolSai Assicurazioni SpA, Series E	3.88%	03/01/2028	5,290	5,790,600	0.2
				<u>7,669,208</u>	<u>0.3</u>
SONSTIGE FINANZWERTE					
Intrum AB	4.88%	08/15/2025	20,850	21,911,744	1.0
Motion Finco SARL	7.00%	05/15/2025	5,825	6,144,727	0.3
				<u>28,056,471</u>	<u>1.3</u>
REITs					
ADLER Group SA	3.25%	08/05/2025	3,300	3,380,671	0.2
ADLER Real Estate AG	3.00%	04/27/2026	7,600	7,777,043	0.3
Aedas Homes Opco SLU	4.00%	08/15/2026	3,250	3,367,722	0.1
Iron Mountain UK PLC	3.88%	11/15/2025	GBP 14,740	17,384,308	0.8
Neinor Homes SA	4.50%	10/15/2026	EUR 3,180	3,268,855	0.1
Peach Property Finance GmbH	3.50%	02/15/2023	2,701	2,752,829	0.1
Peach Property Finance GmbH	4.38%	11/15/2025	2,000	2,085,723	0.1
Via Celere Desarrollos Inmobiliarios SA	5.25%	04/01/2026	3,250	3,399,838	0.2
				<u>43,416,989</u>	<u>1.9</u>
				<u>172,032,836</u>	<u>7.6</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
ContourGlobal Power Holdings SA	3.13%	01/01/2028	4,257	4,354,026	0.2
EDP - Energias de Portugal SA	4.50%	04/30/2079	9,700	10,573,000	0.5
Orano SA, Series E	3.38%	04/23/2026	9,200	10,016,033	0.4
Orano SA, Series E	4.88%	09/23/2024	2,000	2,262,882	0.1
Public Power Corp. SA	3.38%	07/31/2028	2,084	2,140,399	0.1
Public Power Corp. SA	3.88%	03/30/2026	2,385	2,488,754	0.1
				<u>31,835,094</u>	<u>1.4</u>
				<u>982,527,990</u>	<u>43.7</u>

		Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE						
FRANKREICH						
	French Republic Government Bond OAT	4.00%	04/25/2055	EUR 7,385	€ 14,449,425	0.6%
	French Republic Government Bond OAT	8.50%	04/25/2023	76,101	87,698,756	3.9
					<u>102,148,181</u>	<u>4.5</u>
DEUTSCHLAND						
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe	6.25%	01/04/2030	55,300	87,609,486	3.9
	Bundesrepublik Deutschland Bundesanleihe, Series 97	6.50%	07/04/2027	99,700	142,625,779	6.4
					<u>230,235,265</u>	<u>10.3</u>
ITALIEN						
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	4.75%	09/01/2044	37,581	61,149,224	2.7
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	7.25%	11/01/2026	15,162	20,822,984	0.9
	Italy Buoni Poliennali Del Tesoro	9.00%	11/01/2023	59,304	71,385,772	3.2
					<u>153,357,980</u>	<u>6.8</u>
NIEDERLANDE						
	Netherlands Government Bond	7.50%	01/15/2023	5,100	5,681,088	0.3
SPANIEN						
	Spain Government Bond	4.20%	01/31/2037	15,532	23,610,035	1.1
	Spain Government Bond	5.15%	10/31/2044	22,710	42,142,890	1.9
	Spain Government Bond	5.75%	07/30/2032	19,153	30,301,567	1.3
	Spain Government Bond	5.90%	07/30/2026	12,506	16,379,545	0.7
	Spain Government Bond	6.00%	01/31/2029	22,821	33,116,203	1.5
					<u>145,550,240</u>	<u>6.5</u>
					<u>636,972,754</u>	<u>28.4</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN MIT ANLAGEQUALITÄT						
FINANZINSTITUTE						
BANKWESEN						
	ABN AMRO Bank NV, Series E	7.13%	07/06/2022	15,473	16,409,581	0.7
	BNP Paribas SA(a)	6.13%	06/17/2022	13,735	14,326,081	0.6
	CaixaBank SA, Series E	3.75%	02/15/2029	8,500	9,158,031	0.4
	Cooperatieve Rabobank UA(a)	4.38%	06/29/2027	34,600	38,838,500	1.7
	Erste Group Bank AG(a)	4.25%	10/15/2027	18,600	19,999,800	0.9
	Goldman Sachs Group, Inc. (The)	7.13%	08/07/2025	GBP 11,430	16,378,069	0.7
	HSBC Holdings PLC(a)	6.00%	09/29/2023	EUR 5,281	5,762,722	0.3
	HSBC Holdings PLC	6.75%	09/11/2028	GBP 7,050	10,680,987	0.5
	HSBC Holdings PLC, Series E(a)	4.75%	07/04/2029	EUR 15,365	17,458,481	0.8
	KBC Group NV(a)	4.25%	10/24/2025	6,600	7,086,487	0.3
	Lloyds Banking Group PLC	2.71%	12/03/2035	GBP 10,214	12,345,900	0.5
	UBS Group AG(a)	5.75%	02/19/2022	EUR 18,745	19,170,649	0.9
	UniCredit SpA(a)	7.50%	06/03/2026	4,780	5,700,150	0.3
	UniCredit SpA, Series E	6.95%	10/31/2022	34,379	37,087,883	1.7
					<u>230,403,321</u>	<u>10.3</u>
FINANZEN						
	GE Capital UK Funding Unlimited. Co., Series E	5.88%	01/18/2033	GBP 7,405	11,971,237	0.5
VERSICHERUNGEN						
	ASR Nederland NV	3.38%	05/02/2049	EUR 13,599	15,313,288	0.7
	Assicurazioni Generali SpA(a)	6.27%	06/16/2026	GBP 3,000	4,059,248	0.2
	Assicurazioni Generali SpA, Series E	5.50%	10/27/2047	EUR 12,804	15,897,848	0.7
	CNP Assurances(a)	4.75%	06/27/2028	12,000	13,862,489	0.6
	Credit Agricole Assurances SA(a)	4.25%	01/13/2025	1,900	2,116,437	0.1
	Credit Agricole Assurances SA	4.75%	09/27/2048	5,200	6,412,357	0.3
	Liberty Mutual Group, Inc.	3.63%	05/23/2059	18,451	19,261,161	0.8
	Storebrand Livsforsikring AS	6.88%	04/04/2043	4,370	4,843,746	0.2
	Tryg Forsikring A/S(c)	3.09%	11/13/2045	NOK 61,000	6,276,694	0.3
	Unipol Gruppo SpA, Series E	3.25%	09/23/2030	EUR 2,003	2,243,365	0.1
					<u>90,286,633</u>	<u>4.0</u>
REITs						
	Digital Stout Holding LLC	3.75%	10/17/2030	GBP 3,250	4,367,480	0.2
					<u>337,028,671</u>	<u>15.0</u>
INDUSTRIE						
GRUNDSTOFFE						
	Glencore Finance Europe Ltd., Series E	3.13%	03/26/2026	5,430	6,750,016	0.3
	INEOS Finance PLC	3.38%	03/31/2026	EUR 1,714	1,769,860	0.1
					<u>8,519,876</u>	<u>0.4</u>
KOMMUNIKATIONSMEDIEN						
	Time Warner Cable LLC	5.25%	07/15/2042	GBP 10,160	16,153,132	0.7

	Zinssatz	Datum	Kontrakte/Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettover- mögen %
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
AT&T, Inc.	5.50%	03/15/2027	GBP 3,750	€ 5,336,832	0.2%
AT&T, Inc., Series B(a)	2.88%	03/02/2025	EUR 3,200	3,237,023	0.1
AT&T, Inc., Series E	7.00%	04/30/2040	GBP 2,900	5,627,336	0.3
Orange SA, Series E	8.13%	11/20/2028	5,997	10,210,397	0.5
				<u>24,411,588</u>	<u>1.1</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – KFZ					
LKQ European Holdings BV	4.13%	04/01/2028	EUR 2,000	2,150,389	0.1
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
James Hardie International Finance DAC	3.63%	10/01/2026	5,834	5,939,618	0.3
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Anheuser-Busch InBev SA/NV, Series E	9.75%	07/30/2024	GBP 11,922	17,433,624	0.8
Imperial Brands Finance PLC, Series E	9.00%	02/17/2022	3,145	3,802,685	0.1
				<u>21,236,309</u>	<u>0.9</u>
ENERGIE					
BP Capital Markets PLC(a)	3.25%	03/22/2026	EUR 2,295	2,464,158	0.1
SONSTIGE INDUSTRIEWERTE					
Travis Perkins PLC	3.75%	02/17/2026	GBP 742	921,372	0.0
Travis Perkins PLC	4.50%	09/07/2023	8,067	9,997,942	0.5
				<u>10,919,314</u>	<u>0.5</u>
				<u>91,794,384</u>	<u>4.1</u>
VERSORGUNGSBETRIEBE					
ELEKTRIZITÄT					
EDP Finance BV, Series E	8.63%	01/04/2024	9,146	12,569,047	0.6
Electricite de France SA, Series E(a)	5.38%	01/29/2025	EUR 8,000	8,967,113	0.4
Enel SpA(a) (d)	5.45%	01/10/2024	7,010	7,866,789	0.3
Naturgy Finance BV(a)	3.38%	04/24/2024	2,600	2,762,108	0.1
Orsted AS(a)	6.25%	06/26/3013	2,330	2,589,602	0.1
				<u>34,754,659</u>	<u>1.5</u>
				<u>463,577,714</u>	<u>20.6</u>
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – SONSTIGE					
Sazka Group AS	3.88%	02/15/2027	7,285	7,321,425	0.3
Sazka Group AS	4.13%	11/20/2024	7,889	8,046,780	0.4
				<u>15,368,205</u>	<u>0.7</u>
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	4.50%	03/01/2025	3,495	3,632,873	0.2
Teva Pharmaceutical Finance Netherlands II BV	6.00%	01/31/2025	6,247	6,772,440	0.3
				<u>10,405,313</u>	<u>0.5</u>
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
InPost SA	2.25%	07/15/2027	7,525	7,581,155	0.3
				<u>33,354,673</u>	<u>1.5</u>
GEKAUFTE OPTIONEN – VERKAUFSOPTIONEN					
SWAPTIONS					
iTraxx-XOVER Series 35, 5 Year Index, Bank of America, NA Expiration: Sep 2021, Exercise Rate: 3.25%			175,000,000	26,584	0.0
				<u>2,116,459,715</u>	<u>94.2</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN OHNE ANLAGEQUALITÄT					
INDUSTRIE					
GRUNDSTOFFE					
Ahlstrom-Munksjo Holding 3 Oy	3.63%	02/04/2028	EUR 5,149	5,235,295	0.2
KOMMUNIKATIONS MEDIEN					
Summer BidCo BV(b)	9.00%	11/15/2025	6,806	6,908,483	0.3
KOMMUNIKATION/TELEKOMMUNIKATION					
Hellas Telecommunications/Luxembourg III(e)	8.50%	10/15/2049	641	0	0.0
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – UNTERHALTUNG					
Carnival Corp.	10.13%	02/01/2026	4,900	5,603,976	0.3
CPUK Finance Ltd.	4.50%	08/28/2027	GBP 2,732	3,231,612	0.1
				<u>8,835,588</u>	<u>0.4</u>
KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER – EINZELHÄNDLER					
CT Investment GmbH	5.50%	04/15/2026	EUR 4,346	4,473,620	0.2
TRANSPORTWESEN – DIENSTLEISTUNGEN					
Modulaire Global Finance PLC	6.50%	02/15/2023	18,520	18,895,205	0.9
				<u>44,348,191</u>	<u>2.0</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (EUR)	Nettovermögen %
STAMMAKTIEN					
K201640219 South Africa Ltd. A Shares (e)			18,654,746	€ 16	0.0%
REGIERUNGEN – STAATSANLEIHEN					
NIEDERLANDE					
SNS Reaal NV(a) (e)	6.25%	12/31/2049	EUR 770	1	0.0
				44,348,208	2.0
Gesamtanlagen				€ 2,160,807,923	96.2%
(Kosten €2,201,919,892)					
Termineinlagen					
ANZ, London(f)	(0.13)%	–		150,630	0.0
BNP Paribas, Paris(f)	(0.08)%	–		257,644	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Hong Kong(f)	0.00 %	–		72,300	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(f)	0.01 %	–		23	0.0
JPMorgan Chase, New York(f)	0.01 %	–		891,368	0.0
Sumitomo, London(f)	0.01 %	–		2,225,745	0.1
Sumitomo, Tokyo(f)	(0.78)%	–		48,429,232	2.2
Termineinlagen insgesamt				52,026,942	2.3
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				32,661,489	1.5
Nettovermögen				€ 2,245,496,354	100.0%

TERMINKONTRAKTE

Beschreibung	Fälligkeit	Anzahl der Kontrakte	Ursprünglicher Wert	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)
Long					
Euro Buxl 30 Yr Bond Futures	09/08/2021	607	€ 121,043,020	€ 128,999,640	€ 7,956,620
Euro-BOBL Futures	09/08/2021	132	17,742,120	17,816,040	73,920
Euro-BTP Futures	09/08/2021	760	114,328,940	116,500,400	2,171,460
Euro-OAT Futures	09/08/2021	162	25,639,720	26,111,160	471,440
Short					
Euro-Bund Futures	09/08/2021	487	83,588,680	85,444,150	(1,855,470)
Euro-Schatz Futures	09/08/2021	161	18,057,760	18,077,080	(19,320)
					€ 8,798,650
				Wertsteigerung	€ 10,673,440
				Wertminderung	€ (1,874,790)

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungsdatum	Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung)	
Bank of America, NA.	NOK 49,441	EUR 4,781	10/13/2021	€ (30,710)	
Brown Brothers Harriman & Co.	GBP 1,270	EUR 1,483	11/10/2021	5,340	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,821	CNH 21,784	09/08/2021	37,932	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 379,872	USD 448,383	09/08/2021	(169,655)	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 101,367	USD 119,816	09/08/2021	96,678	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,888	CNH 22,011	09/13/2021	(1,306)	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 42,139	HKD 385,110	09/13/2021	(210,154)	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 73	PLN 335	09/13/2021	920	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 6,851	SGD 10,912	09/13/2021	21,335	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 481,243	USD 565,370	09/13/2021	(2,523,410)	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 157,605	AUD 255,608	10/01/2021	693,387	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 2,979	CHF 3,215	10/01/2021	(5,701)	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 3,078	SGD 4,889	10/01/2021	(330)	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 481,266	USD 565,423	10/01/2021	(2,693,483)	
Brown Brothers Harriman & Co.+	EUR 32,972	HKD 301,795	10/07/2021	(129,081)	
Citibank, NA	GBP 225,381	EUR 262,756	11/10/2021	648,428	
Morgan Stanley & Co., Inc.	GBP 1,717	EUR 2,003	11/10/2021	5,226	
				€ (4,254,584)	
				Wertsteigerung	€ 1,509,246
				Wertminderung	€ (5,763,830)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

VERKAUFTE CREDIT-DEFAULT-SWAPTIONS

Referenz-Obligation	Gegenpartei	Kauf-/Ver- kaufsschutz	Ausübungs- kurs	Fälligkeit	Nominal- betrag (000)	Prämien	Marktwert
Put - iTraxx-XOVER Series 35, 5 Year Index	Bank of America, NA	Sell	4.00%	Sep 2021	EUR 175,000	€ 507,500	€ <u>(15,267)</u>

- (a) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (b) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (c) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. August 2021.
- (d) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. August 2021.
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (f) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

- BOBL – Bundesobligationen
- BTP – Buoni del Tesoro Poliennali
- OAT – Obligations Assimilables du Trésor
- 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					
STAATSANLEIHEN					
Angolan Government International Bond	9.13%	11/26/2049	USD 8,217	\$ 8,557,492	1.0%
Angolan Government International Bond	9.38%	05/08/2048	11,791	12,482,247	1.4
Argentine Republic Government International Bond	0.50%	07/09/2030	20,774	8,080,986	0.9
Argentine Republic Government International Bond	1.00%	07/09/2029	3,315	1,344,213	0.2
Argentine Republic Government International Bond	1.13%	07/09/2035	46,280	16,082,220	1.9
Argentine Republic Government International Bond	2.00%	01/09/2038	4,982	2,034,952	0.2
Argentine Republic Government International Bond	2.50%	07/09/2041	2,951	1,150,788	0.1
Bahamas Government International Bond	8.95%	10/15/2032	3,993	4,340,641	0.5
Bahrain Government International Bond	5.45%	09/16/2032	221	216,580	0.0
Bahrain Government International Bond	5.63%	09/30/2031	3,880	3,868,602	0.4
Bahrain Government International Bond	6.00%	09/19/2044	6,065	5,668,122	0.7
Bahrain Government International Bond	6.75%	09/20/2029	3,508	3,804,645	0.4
Bahrain Government International Bond	7.00%	10/12/2028	1,754	1,931,593	0.2
Bahrain Government International Bond	7.38%	05/14/2030	3,951	4,392,524	0.5
Chile Government International Bond	2.55%	01/27/2032	10,678	10,970,310	1.3
Colombia Government International Bond	3.13%	04/15/2031	1,493	1,457,355	0.2
Colombia Government International Bond	3.25%	04/22/2032	8,680	8,467,340	1.0
Colombia Government International Bond	3.88%	04/25/2027	7,570	8,013,791	0.9
Colombia Government International Bond	5.00%	06/15/2045	2,855	2,983,118	0.3
Colombia Government International Bond	5.63%	02/26/2044	200	222,788	0.0
Colombia Government International Bond	6.13%	01/18/2041	2,985	3,480,883	0.4
Colombia Government International Bond	7.38%	09/18/2037	2,044	2,640,976	0.3
Dominican Republic International Bond	5.50%	01/27/2025	423	462,603	0.1
Dominican Republic International Bond	5.88%	01/30/2060	4,612	4,700,781	0.5
Dominican Republic International Bond	6.40%	06/05/2049	450	491,991	0.1
Dominican Republic International Bond	6.50%	02/15/2048	7,022	7,762,821	0.9
Dominican Republic International Bond	6.85%	01/27/2045	3,091	3,545,570	0.4
Ecuador Government International Bond	0.00%	07/31/2030	1,753	988,190	0.1
Ecuador Government International Bond	0.50%	07/31/2040	5,362	3,425,108	0.4
Ecuador Government International Bond	1.00%	07/31/2035	11,188	8,055,779	1.0
Ecuador Government International Bond	5.00%	07/31/2030	9,890	8,839,095	1.0
Egypt Government International Bond	3.88%	02/16/2026	2,534	2,483,320	0.3
Egypt Government International Bond	5.63%	04/16/2030	EUR 3,111	3,684,333	0.4
Egypt Government International Bond	5.88%	02/16/2031	USD 837	822,353	0.1
Egypt Government International Bond	7.05%	01/15/2032	836	865,285	0.1
Egypt Government International Bond	7.50%	01/31/2027	3,693	4,092,998	0.5
Egypt Government International Bond	7.50%	02/16/2061	1,883	1,784,143	0.2
Egypt Government International Bond	7.90%	02/21/2048	7,077	7,000,922	0.8
Egypt Government International Bond	8.15%	11/20/2059	2,673	2,659,301	0.3
Egypt Government International Bond	8.50%	01/31/2047	4,262	4,465,244	0.5
Egypt Government International Bond	8.88%	05/29/2050	3,563	3,819,759	0.4
El Salvador Government International Bond	5.88%	01/30/2025	3,134	2,765,755	0.3
El Salvador Government International Bond	6.38%	01/18/2027	3,636	3,145,140	0.4
El Salvador Government International Bond	7.12%	01/20/2050	9,647	7,874,364	0.9
El Salvador Government International Bond	7.65%	06/15/2035	506	438,323	0.1
El Salvador Government International Bond	7.75%	01/24/2023	2,961	2,805,547	0.3
El Salvador Government International Bond	8.63%	02/28/2029	817	753,683	0.1
Finance Department Government of Sharjah	4.00%	07/28/2050	1,063	966,001	0.1
Gabon Government International Bond	6.38%	12/12/2024	406	435,947	0.1
Gabon Government International Bond	6.63%	02/06/2031	1,784	1,809,980	0.2
Gabon Government International Bond	6.95%	06/16/2025	3,807	4,200,311	0.5
Ghana Government International Bond	7.63%	05/16/2029	2,108	2,106,419	0.2
Ghana Government International Bond	7.75%	04/07/2029	1,542	1,551,638	0.2
Ghana Government International Bond	7.88%	03/26/2027	3,415	3,509,553	0.4
Ghana Government International Bond	7.88%	02/11/2035	5,221	5,009,876	0.6
Ghana Government International Bond	8.13%	03/26/2032	1,700	1,699,788	0.2
Ghana Government International Bond	8.63%	04/07/2034	941	950,410	0.1
Ghana Government International Bond	8.63%	06/16/2049	4,933	4,715,023	0.5
Ghana Government International Bond	8.75%	03/11/2061	559	536,046	0.1
Ghana Government International Bond	8.95%	03/26/2051	4,142	4,058,642	0.5
Hazine Mustesarligi Varlik Kiralama AS	5.13%	06/22/2026	1,180	1,182,950	0.1
Honduras Government International Bond	6.25%	01/19/2027	1,124	1,242,231	0.1
Honduras Government International Bond	7.50%	03/15/2024	1,621	1,734,267	0.2
Ivory Coast Government International Bond	5.38%	07/23/2024	3,925	4,191,900	0.5
Ivory Coast Government International Bond	6.13%	06/15/2033	7,476	8,192,294	0.9
Ivory Coast Government International Bond	6.38%	03/03/2028	4,615	5,137,937	0.6
Ivory Coast Government International Bond	6.63%	03/22/2048	EUR 1,873	2,375,061	0.3
Jamaica Government International Bond	7.88%	07/28/2045	USD 3,368	4,756,879	0.5
Lebanon Government International Bond(a)	6.00%	01/27/2023	1,360	170,000	0.0
Lebanon Government International Bond(a)	6.65%	04/22/2024	3,748	468,500	0.1
Lebanon Government International Bond, Series E(a)	6.10%	10/04/2022	6,321	790,125	0.1
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.60%	11/27/2026	1,719	214,875	0.0
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.20%	02/26/2025	4,428	553,500	0.1
Lebanon Government International Bond, Series G(a)	6.65%	03/23/2027	4,936	617,000	0.1

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Mexico Government International Bond	5.00%	04/27/2051	USD 3,181	\$ 3,703,479	0.4%
Mexico Government International Bond	5.63%	05/01/2023	1,061	1,116,570	0.1
Nigeria Government International Bond	6.50%	11/28/2027	4,366	4,597,398	0.5
Nigeria Government International Bond	7.63%	11/28/2047	2,932	2,944,461	0.3
Nigeria Government International Bond	7.70%	02/23/2038	2,993	3,059,968	0.4
Nigeria Government International Bond	7.88%	02/16/2032	3,296	3,539,698	0.4
Oman Government International Bond	4.88%	02/01/2025	1,567	1,639,278	0.2
Oman Government International Bond	5.63%	01/17/2028	481	508,658	0.1
Oman Government International Bond	6.25%	01/25/2031	2,927	3,183,112	0.4
Oman Government International Bond	6.50%	03/08/2047	2,125	2,127,391	0.2
Oman Government International Bond	6.75%	01/17/2048	10,071	10,283,750	1.2
Pakistan Government International Bond	6.88%	12/05/2027	2,613	2,672,282	0.3
Pakistan Government International Bond	7.38%	04/08/2031	3,633	3,678,812	0.4
Pakistan Government International Bond	8.25%	04/15/2024	200	214,475	0.0
Panama Bonos Del	3.36%	06/30/2031	4,391	4,481,564	0.5
Panama Government International Bond	3.88%	03/17/2028	945	1,045,583	0.1
Panama Government International Bond	8.88%	09/30/2027	1,714	2,366,177	0.3
Panama Government International Bond	9.38%	04/01/2029	2,431	3,610,035	0.4
Paraguay Government International Bond	4.95%	04/28/2031	3,000	3,474,000	0.4
Paraguay Government International Bond	5.40%	03/30/2050	1,074	1,278,261	0.2
Peruvian Government International Bond	2.78%	01/23/2031	3,993	4,081,096	0.5
Peruvian Government International Bond	3.23%	07/28/2121	1,944	1,705,617	0.2
Petroamazonas EP	4.63%	12/06/2021	290	286,724	0.0
Philippine Government International Bond	3.20%	07/06/2046	3,472	3,572,202	0.4
Qatar Government International Bond	4.40%	04/16/2050	8,225	10,199,000	1.2
Qatar Government International Bond	4.82%	03/14/2049	2,745	3,584,455	0.4
Qatar Government International Bond	5.10%	04/23/2048	3,138	4,218,256	0.5
Republic of Kenya Government International Bond	6.88%	06/24/2024	2,457	2,700,089	0.3
Republic of South Africa Government International Bond	5.00%	10/12/2046	1,167	1,091,729	0.1
Republic of South Africa Government International Bond	5.38%	07/24/2044	2,133	2,118,069	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.65%	09/27/2047	1,539	1,545,541	0.2
Republic of South Africa Government International Bond	5.75%	09/30/2049	4,897	4,926,994	0.6
Russian Foreign Bond - Eurobond	5.25%	06/23/2047	12,800	16,546,400	1.9
Saudi Government International Bond	5.00%	04/17/2049	1,617	2,049,548	0.2
Saudi Government International Bond	5.25%	01/16/2050	2,098	2,759,919	0.3
Senegal Government International Bond	4.75%	03/13/2028	EUR 789	987,101	0.1
Senegal Government International Bond	6.75%	03/13/2048	USD 5,819	6,045,577	0.7
Serbia International Bond	2.13%	12/01/2030	1,135	1,093,360	0.1
Sri Lanka Government International Bond	6.20%	05/11/2027	1,443	930,555	0.1
Sri Lanka Government International Bond	6.85%	11/03/2025	5,158	3,439,096	0.4
Turkey Government International Bond	4.25%	03/13/2025	2,374	2,360,350	0.3
Turkey Government International Bond	4.75%	01/26/2026	5,273	5,253,226	0.6
Turkey Government International Bond	4.88%	04/16/2043	4,466	3,669,091	0.4
Turkey Government International Bond	5.75%	05/11/2047	4,881	4,331,277	0.5
Turkey Government International Bond	6.63%	02/17/2045	1,430	1,402,115	0.2
Ukraine Government International Bond	6.75%	06/20/2026	EUR 1,222	1,590,140	0.2
Ukraine Government International Bond	6.88%	05/21/2029	USD 2,527	2,668,512	0.3
Ukraine Government International Bond	7.25%	03/15/2033	1,200	1,271,475	0.1
Ukraine Government International Bond	7.38%	09/25/2032	2,420	2,586,072	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2024	2,294	2,515,228	0.3
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2025	3,943	4,353,072	0.5
Ukraine Government International Bond	7.75%	09/01/2026	8,390	9,327,582	1.1
Ukraine Government International Bond	8.99%	02/01/2024	1,750	1,946,875	0.2
Ukraine Government International Bond	9.75%	11/01/2028	763	924,327	0.1
Ukraine Government International Bond, Series GDP(b)	0.00%	05/31/2040	5,368	6,103,751	0.7
Uruguay Government International Bond	4.38%	01/23/2031	2,620	3,088,163	0.4
Uruguay Government International Bond	4.98%	04/20/2055	743	979,759	0.1
Uruguay Government International Bond	5.10%	06/18/2050	2,094	2,788,322	0.3
Venezuela Government International Bond(c)	7.75%	10/13/2019	2,834	283,380	0.0
Venezuela Government International Bond(a)	9.00%	05/07/2023	5,842	584,240	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	09/15/2027	4,619	461,900	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	9.25%	05/07/2028	8,171	827,334	0.1
Venezuela Government International Bond(a)	11.95%	08/05/2031	762	77,122	0.0
Venezuela Government International Bond(a)	12.75%	08/23/2022	2,087	208,740	0.0
Zambia Government International Bond(a)	8.97%	07/30/2027	9,901	7,747,532	0.9
				<u>463,857,592</u>	<u>53.3</u>
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
Absa Group Ltd.(d)	6.38%	05/27/2026	638	666,710	0.1
Abu Dhabi National Energy Co. PJSC	4.00%	10/03/2049	1,500	1,741,219	0.2
AES Andes SA	6.35%	10/07/2079	1,162	1,214,290	0.1
AES Panama Generation Holdings SRL	4.38%	05/31/2030	1,353	1,401,877	0.2
Autopistas del Sol SA/Costa Rica	7.38%	12/30/2030	2,144	2,242,702	0.3
Banco de Credito del Peru	3.13%	07/01/2030	700	696,062	0.1
Bangkok Bank PCL/Hong Kong	3.73%	09/25/2034	2,429	2,509,157	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Bioceanico Sovereign Certificate Ltd.	0.00%	06/05/2034	USD 2,163	\$ 1,651,950	0.2%
Braskem Idesa SAPI	7.45%	11/15/2029	3,844	4,045,810	0.5
Braskem Netherlands Finance BV	4.50%	01/10/2028	2,246	2,434,583	0.3
BRF SA	5.75%	09/21/2050	1,077	1,089,655	0.1
Celulosa Arauco y Constitucion SA	4.20%	01/29/2030	1,088	1,187,824	0.2
Cemex SAB de CV	3.88%	07/11/2031	1,767	1,817,801	0.2
Cemex SAB de CV(d)	5.13%	09/08/2169	1,356	1,415,664	0.2
Cemex SAB de CV	7.38%	06/05/2027	2,148	2,420,796	0.3
Cemig Geracao e Transmissao SA	9.25%	12/05/2024	1,959	2,245,993	0.3
Central American Bottling Corp.	5.75%	01/31/2027	2,103	2,192,377	0.3
Central China Real Estate, Ltd.	7.50%	07/14/2025	330	250,897	0.0
Central China Real Estate, Ltd.	7.75%	05/24/2024	200	154,629	0.0
Chile Electricity PEC SpA	0.00%	01/25/2028	3,495	2,831,497	0.3
China Aoyuan Group Ltd.	5.88%	03/01/2027	200	166,450	0.0
China Cinda 2020 I Management Ltd.	3.00%	01/20/2031	322	321,759	0.0
China Cinda Finance 2017 I Ltd.	4.40%	03/09/2027	967	1,056,629	0.1
Cia de Minas Buenaventura SAA	5.50%	07/23/2026	1,288	1,269,646	0.1
Consolidated Energy Finance SA	6.88%	06/15/2025	973	1,003,917	0.1
Contemporary Ruiding Development Ltd.	2.63%	09/17/2030	2,820	2,863,385	0.3
CSN Resources SA	4.63%	06/10/2031	1,723	1,784,825	0.2
Ecopetrol SA	6.88%	04/29/2030	5,220	6,284,984	0.7
Ecopetrol SA	7.38%	09/18/2043	2,435	2,978,005	0.3
Embraer Netherlands Finance BV	5.40%	02/01/2027	2,350	2,515,969	0.3
Empresa Electrica Cochran SpA	5.50%	05/14/2027	1,492	1,496,163	0.2
Empresas Publicas de Medellin ESP	4.25%	07/18/2029	2,504	2,489,289	0.3
Energuate Trust	5.88%	05/03/2027	3,311	3,448,200	0.4
Engie Energia Chile SA	3.40%	01/28/2030	3,394	3,494,335	0.4
Gran Colombia Gold Corp.	6.88%	08/09/2026	2,400	2,399,813	0.3
Gran Tierra Energy International Holdings Ltd.	6.25%	02/15/2025	5,449	4,739,612	0.5
Gran Tierra Energy, Inc.	7.75%	05/23/2027	1,291	1,123,575	0.1
Grupo Energia Bogota SA ESP	4.88%	05/15/2030	724	812,292	0.1
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	3.75%	04/27/2022	1,104	1,084,680	0.1
Huarong Finance 2017 Co., Ltd.	4.75%	04/27/2027	1,175	1,163,250	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.25%	11/13/2024	465	445,238	0.1
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	3.75%	05/29/2024	227	221,325	0.0
Huarong Finance 2019 Co., Ltd.	4.50%	05/29/2029	1,047	1,012,972	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.63%	06/03/2026	865	856,350	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	4.88%	11/22/2026	684	682,290	0.1
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.00%	11/19/2025	1,339	1,345,695	0.2
Huarong Finance II Co., Ltd.	5.50%	01/16/2025	2,844	2,900,880	0.3
Hunt Oil Co. of Peru LLC Sucursal Del Peru	6.38%	06/01/2028	911	928,821	0.1
Indian Renewable Energy Development Agency Ltd., Series E	7.13%	10/10/2022	INR 160,000	2,213,471	0.3
Indika Energy Capital IV Pte Ltd.	8.25%	10/22/2025	USD 2,662	2,797,443	0.3
Inkia Energy Ltd.	5.88%	11/09/2027	1,179	1,207,591	0.1
Intercorp Financial Services, Inc.	4.13%	10/19/2027	1,268	1,285,435	0.1
Intercorp Peru Ltd.	3.88%	08/15/2029	1,246	1,196,160	0.1
Inversiones CMPC SA	3.85%	01/13/2030	1,118	1,203,108	0.1
Inversiones CMPC SA	4.38%	04/04/2027	1,847	2,057,443	0.2
Investment Energy Resources Ltd.	6.25%	04/26/2029	585	639,898	0.1
Klabn Austria GmbH	3.20%	01/12/2031	2,265	2,237,658	0.3
Kosmos Energy Ltd.	7.50%	03/01/2028	1,428	1,359,200	0.2
Leviathan Bond Ltd.	6.75%	06/30/2030	1,415	1,585,198	0.2
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	4.35%	04/05/2036	2,040	2,180,698	0.2
Lima Metro Line 2 Finance Ltd.	5.88%	07/05/2034	3,940	4,643,316	0.5
Medco Oak Tree Pte Ltd.	7.38%	05/14/2026	1,315	1,417,981	0.2
Minerva Luxembourg SA	4.38%	03/18/2031	1,785	1,751,685	0.2
MV24 Capital BV	6.75%	06/01/2034	583	634,494	0.1
National Central Cooling Co. PJSC	2.50%	10/21/2027	974	971,565	0.1
Nexa Resources SA	6.50%	01/18/2028	3,767	4,165,778	0.5
OEC Finance Ltd.(e)	4.38%	10/25/2029	268	26,936	0.0
OEC Finance Ltd.	4.38%	10/25/2029	623	62,587	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	5.25%	12/27/2033	1,467	140,661	0.0
OEC Finance Ltd.(e)	7.13%	12/26/2046	498	45,048	0.0
Oi Movel SA	8.75%	07/30/2026	1,773	1,834,700	0.2
Oleoducto Central SA	4.00%	07/14/2027	1,329	1,373,272	0.2
Peru LNG SRL	5.38%	03/22/2030	3,590	2,847,319	0.3
Petrobras Global Finance BV	5.50%	06/10/2051	1,440	1,441,383	0.2
Petrobras Global Finance BV	6.90%	03/19/2049	1,010	1,199,590	0.1
Petrobras Global Finance BV	8.75%	05/23/2026	2,062	2,646,190	0.3
Prosus NV	3.68%	01/21/2030	2,435	2,527,530	0.3
Prosus NV	4.03%	08/03/2050	620	582,240	0.1
PTTEP Treasury Center Co., Ltd.	3.90%	12/06/2059	986	1,049,173	0.1
Rutas 2 and 7 Finance Ltd.	0.00%	09/30/2036	1,535	1,124,215	0.1
Scenery Journey Ltd.	11.50%	10/24/2022	794	274,009	0.0
Scenery Journey Ltd.	12.00%	10/24/2023	1,106	376,040	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
SEPLAT Energy PLC.....	7.75%	04/01/2026	USD 1,894	\$ 1,965,025	0.2%
SierraCol Energy Andina LLC.....	6.00%	06/15/2028	1,092	1,089,142	0.1
SK Hynix, Inc.....	2.38%	01/19/2031	2,214	2,184,487	0.3
Suzano Austria GmbH.....	3.75%	01/15/2031	1,487	1,563,036	0.2
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.....	3.25%	08/15/2030	2,279	2,341,551	0.3
Tengizchevroil Finance Co. International Ltd.....	4.00%	08/15/2026	1,083	1,176,218	0.1
TransJamaican Highway Ltd.....	5.75%	10/10/2036	2,108	2,111,058	0.2
Transportadora de Gas Internacional SA ESP.....	5.55%	11/01/2028	2,311	2,627,029	0.3
Tullow Oil PLC.....	10.25%	05/15/2026	3,609	3,733,511	0.4
Turkiye Vakiflar Bankasi TAO.....	6.50%	01/08/2026	3,117	3,218,302	0.4
UEP Penonome II SA.....	6.50%	10/01/2038	3,686	3,822,154	0.4
Vedanta Resources Finance II PLC.....	13.88%	01/21/2024	4,356	4,793,548	0.6
Volcan Cia Minera SAA.....	4.38%	02/11/2026	3,540	3,431,941	0.4
Xiaomi Best Time International Ltd.....	2.88%	07/14/2031	2,652	2,667,415	0.3
Yango Justice International Ltd.....	7.50%	02/17/2025	530	453,150	0.1
YPF SA.....	8.75%	04/04/2024	2,490	2,288,497	0.3
Zorlu Yenilenebilir Enerji AS.....	9.00%	06/01/2026	3,285	3,223,406	0.4
				<u>178,890,327</u>	<u>20.5</u>
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.....	4.00%	08/11/2041	765	783,790	0.1
Aeropuerto Internacional de Tocumen SA.....	5.13%	08/11/2061	2,268	2,404,080	0.3
Airport Authority(d).....	2.40%	03/08/2028	2,978	3,005,546	0.3
Banco Nacional De Panama.....	2.50%	08/11/2030	2,321	2,245,568	0.3
Comision Federal de Electricidad.....	3.35%	02/09/2031	1,328	1,324,514	0.2
Comision Federal de Electricidad.....	4.68%	02/09/2051	1,193	1,171,973	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile.....	3.15%	01/14/2030	439	463,090	0.1
Corp. Nacional del Cobre de Chile.....	3.75%	01/15/2031	808	889,204	0.1
DP World Crescent Ltd.....	3.88%	07/18/2029	2,475	2,685,375	0.3
DP World Ltd./United Arab Emirates.....	5.63%	09/25/2048	1,706	2,141,030	0.2
DP World Salaam(d).....	6.00%	10/01/2025	2,195	2,399,958	0.3
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA.....	3.65%	05/07/2030	322	349,760	0.0
Empresa de Transporte de Pasajeros Metro SA.....	5.00%	01/25/2047	240	291,336	0.0
Eskom Holdings SOC Ltd.....	6.35%	08/10/2028	5,381	5,976,139	0.7
Eskom Holdings SOC Ltd.....	6.75%	08/06/2023	2,633	2,747,536	0.3
Eskom Holdings SOC Ltd.....	7.13%	02/11/2025	5,350	5,650,269	0.7
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT.....	5.45%	05/15/2030	1,565	1,823,029	0.2
Indonesia Asahan Aluminium Persero PT.....	5.80%	05/15/2050	1,375	1,645,531	0.2
KazMunayGas National Co. JSC.....	5.38%	04/24/2030	3,747	4,487,894	0.5
KazMunayGas National Co. JSC.....	5.75%	04/19/2047	1,546	1,928,635	0.2
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC.....	7.38%	07/19/2022	2,557	2,633,807	0.3
NAK Naftogaz Ukraine via Kondor Finance PLC.....	7.63%	11/08/2026	1,322	1,357,364	0.2
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	7.50%	10/25/2027	3,015	3,334,025	0.4
Oil and Gas Holding Co. BSCC (The).....	7.63%	11/07/2024	2,935	3,251,099	0.4
Pertamina Persero PT.....	5.63%	05/20/2043	455	551,062	0.1
Pertamina Persero PT.....	6.00%	05/03/2042	3,625	4,542,125	0.5
Pertamina Persero PT.....	6.45%	05/30/2044	1,854	2,465,009	0.3
Pertamina Persero PT.....	6.50%	05/27/2041	2,782	3,671,023	0.4
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara.....	3.88%	07/17/2029	3,131	3,364,455	0.4
Perusahaan Perseroan Persero PT Perusahaan Listrik Negara.....	6.15%	05/21/2048	1,421	1,796,855	0.2
Petroleos de Venezuela SA(a).....	5.38%	04/12/2027	7,377	324,601	0.0
Petroleos de Venezuela SA(a).....	5.50%	04/12/2037	8,347	365,181	0.0
Petroleos de Venezuela SA(a).....	9.00%	11/17/2021	9,326	410,347	0.0
Petroleos Mexicanos.....	5.95%	01/28/2031	4,821	4,733,740	0.5
Petroleos Mexicanos.....	6.50%	03/13/2027	4,652	4,924,142	0.6
Petroleos Mexicanos.....	6.75%	09/21/2047	6,140	5,393,990	0.6
Petroleos Mexicanos.....	6.84%	01/23/2030	2,493	2,602,069	0.3
Petroleos Mexicanos.....	6.95%	01/28/2060	11,959	10,460,537	1.2
Petroleos Mexicanos.....	7.69%	01/23/2050	4,389	4,190,486	0.5
Qatar Petroleum.....	3.30%	07/12/2051	2,382	2,450,483	0.3
Sinopec Group Overseas Development 2018 Ltd.....	2.70%	05/13/2030	4,221	4,370,845	0.5
Southern Gas Corridor CJSC.....	6.88%	03/24/2026	2,311	2,736,080	0.3
State Agency of Roads of Ukraine.....	6.25%	06/24/2028	2,984	2,994,444	0.3
State Oil Co. of the Azerbaijan Republic.....	6.95%	03/18/2030	3,165	3,922,226	0.5
Trinidad Generation UnLtd.....	5.25%	11/04/2027	2,327	2,389,538	0.3
				<u>123,649,790</u>	<u>14.2</u>
SCHWELLENMÄRKTE – SCHATZPAPIERE					
Egypt Government Bond, Series 5YR.....	14.06%	01/12/2026	EGP 146,639	9,040,075	1.0
Republic of South Africa Government Bond, Series 2030.....	8.00%	01/31/2030	ZAR 198,208	13,028,746	1.5
Republic of South Africa Government Bond, Series 2048.....	8.75%	02/28/2048	70,366	4,153,723	0.5
Republic of South Africa Government Bond, Series R213.....	7.00%	02/28/2031	115,062	6,870,746	0.8
				<u>33,093,290</u>	<u>3.8</u>

	Zinssatz	Datum	Anteile/Kontrakte/ Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
SCHATZOBBLIGATIONEN					
Mexican Bonos, Series M	8.00%	11/07/2047	MXN 152,574	\$ 7,912,535	0.9%
Peru Government Bond	6.15%	08/12/2032	PEN 41,868	10,094,320	1.2
				<u>18,006,855</u>	<u>2.1</u>
REGIERUNGEN – SCHATZPAPIERE					
Egypt Treasury Bills, Series 364D	0.00%	01/04/2022	EGP 283,100	17,254,224	2.0
INVESTMENTGESELLSCHAFTEN					
AB SICAV I - Emerging Market Corporate Debt Portfolio - Class S			USD 120,265	3,358,990	0.4
REGIONALANLEIHEN					
Provincia de Neuquen Argentina	2.50%	04/27/2030	2,798	1,730,823	0.2
INFLATIONSgebundene Wertpapiere					
Fideicomiso PA Concesion Ruta al Mar	6.75%	02/15/2044	COP 3,129,329	621,191	0.1
				<u>840,463,082</u>	<u>96.6</u>
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE					
INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
Digicel Group Holdings Ltd.(e)	10.00%	04/01/2024	USD 4,549	4,516,023	0.5
Digicel Group Holdings Ltd.(d) (e)	7.00%	09/15/2021	208	163,614	0.0
Digicel Group Holdings Ltd.(e)	8.00%	04/01/2025	465	401,471	0.1
Odebrecht Holdco Finance Ltd.	0.00%	09/10/2058	3,385	16,928	0.0
Tonon Luxembourg SA(a) (e) (f)	6.50%	10/31/2024	1,516	15,308	0.0
USJ-Acucar e Alcool S/A(a)	9.88%	11/09/2023	4,432	1,373,867	0.2
Virgolino de Oliveira Finance SA(c)	10.50%	01/28/2018	1,016	10,160	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(c)	10.88%	01/13/2020	2,474	309,250	0.0
Virgolino de Oliveira Finance SA(a)	11.75%	02/09/2022	2,561	12,805	0.0
				<u>6,819,426</u>	<u>0.8</u>
SCHATZOBBLIGATIONEN					
Russian Federal Bond - OFZ Series 6228	7.65%	04/10/2030	RUB 316,562	4,539,707	0.5
QUASI-STAAATSANLEIHEN					
Petroleos Mexicanos	6.88%	08/04/2026	USD 1,770	1,928,751	0.2
				<u>13,287,884</u>	<u>1.5</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$872,574,406)				\$ 853,750,966	98.1%
Termineinlagen					
Barclays, London(g)	0.01 %	–		190	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	(0.13)%	–		54,439	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	0.01 %	–		203	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	0.01 %	–		258	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	4.00 %	–		54,269	0.0
Hong Kong & Shanghai Bank, Singapore(g)	0.01 %	–		298	0.0
HSBC Bank PLC, Paris(g)	(0.78)%	–		354	0.0
Sumitomo, Tokyo(g)	0.01 %	–		2,831,260	0.4
Termineinlagen insgesamt				<u>2,941,271</u>	<u>0.4</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>13,426,409</u>	<u>1.5</u>
Nettovermögen				<u>\$ 870,118,646</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Bank of America, NA	USD 4,219	RUB 315,001	09/30/2021	\$ 64,940
Bank of America, NA	INR 162,017	USD 2,148	10/08/2021	(63,153)
BNP Paribas SA	ZAR 14,671	USD 999	09/16/2021	(8,690)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 188	CNH 1,231	09/08/2021	2,327
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 175,478	EUR 149,364	09/13/2021	921,978
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 87,056	AUD 120,169	10/01/2021	869,401
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,489	CAD 1,891	10/01/2021	9,759
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 22	CHF 20	10/01/2021	80
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 1,762	GBP 1,285	10/01/2021	4,843
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 4,342	NZD 6,257	10/01/2021	66,361
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 7,834	PLN 30,553	10/01/2021	143,398
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 6,741	SGD 9,113	10/01/2021	37,279
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 49,136	ZAR 735,954	10/01/2021	1,324,452
Goldman Sachs Bank USA	ZAR 67,746	USD 4,622	09/16/2021	(32,109)
Goldman Sachs Bank USA	ZAR 189,117	USD 13,611	09/16/2021	617,810
HSBC Bank USA	ZAR 67,562	USD 4,589	09/16/2021	(52,518)
JPMorgan Chase Bank, NA	RUB 653,724	USD 8,865	09/30/2021	(25,368)

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Morgan Stanley & Co. LLC.	COP 3,528,784	USD 901	09/16/2021	\$ (34,889)
UBS AG.	USD 550	ZAR 7,928	09/16/2021	(5,119)
UBS AG.	ZAR 26,627	USD 1,804	09/16/2021	(25,579)
UBS AG.	USD 1,010	MXN 20,699	10/28/2021	12,807
UBS AG.	EUR 7,443	USD 8,848	11/08/2021	48,103
				\$ 3,876,113
			Wertsteigerung	\$ 4,123,538
			Wertminderung	\$ (247,425)

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Kaufkontrakte					
Morgan Stanley & Co., LLC/(INTRCONX)	CDX-NAHY Series 35, 5 Year Index	06/20/2026	USD 26,750	\$ 634,978	\$ (184,061)

ZENTRAL ABGERECHNETE INFLATIONSSWAPS (CPI)

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	USD 6,380	02/22/2051	CPI#	2.348%	\$ (369,945)

Variabler Zinssatz auf Basis der gemäß Verbraucherpreisindex ermittelten Inflationsrate.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	USD 19,760	05/21/2031	1.645%	3 Month LIBOR	\$ (591,121)
Morgan Stanley & Co., LLC/(CME Group)	10,110	02/22/2051	1.854%	3 Month LIBOR	(488,177)
Insgesamt					\$ (1,079,298)
Swaps insgesamt					\$ (1,633,304)

- (a) Not leidend.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. August 2021.
- (c) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (d) Die Wertpapiere sind unbefristet und haben somit kein festgelegtes Fälligkeitsdatum. Das ggf. angezeigte Datum spiegelt den nächsten Stichtag wider.
- (e) Zahlungen in Sachwerten (PIK).
- (f) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

- AUD – Australian Dollar
- CAD – Canadian Dollar
- CHF – Swiss Franc
- 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
PEN – Peruvian Sol
PLN – Polish Zloty
RUB – Russian Ruble
SGD – Singapore Dollar
USD – United States Dollar
ZAR – South African Rand

Glossar:

CDX-NAHY – North American High Yield Credit Default Swap Index
CJSC – Closed Joint Stock Company
CME – Chicago Mercantile Exchange
CPI – Consumer Price Index
INTRCONX – Inter-Continental Exchange
JSC – Joint Stock Company
LCH – London Clearing House
LIBOR – London Interbank Offered Rate
PJSC – Public Joint Stock Company

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettowert- mögen %
ÜBERTRAGBARE BÖRSENNOTIERTE ODER AN EINEM ANDEREN GEREGLTEN MARKT GEHANDELTE WERTPAPIERE					
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN					
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH					
Bellemeade Re Ltd.					
Series 2017-1, Class M2(a)	3.43%	10/25/2027	USD 2,056	\$ 2,075,922	0.1%
Series 2019-1A, Class M1B(a)	1.83%	03/25/2029	8,000	7,999,997	0.5
Series 2019-3A, Class M1C(a)	2.03%	07/25/2029	6,115	6,115,325	0.4
Series 2020-3A, Class M2(a)	4.93%	10/25/2030	4,000	4,275,780	0.3
Series 2021-1A, Class M1C(a)	3.00%	03/25/2031	3,000	3,119,117	0.2
Series 2021-1A, Class M2(a)	4.90%	03/25/2031	2,000	2,146,898	0.1
Connecticut Avenue Securities Trust					
Series 2018-R07, Class 1B1(a)	4.43%	04/25/2031	2,000	2,071,939	0.1
Series 2019-HRP1, Class M2(a)	2.23%	11/25/2039	4,359	4,339,742	0.3
Series 2019-R01, Class 2B1(a)	4.43%	07/25/2031	4,691	4,823,509	0.3
Series 2019-R04, Class 2B1(a)	5.33%	06/25/2039	8,000	8,283,226	0.6
Series 2019-R05, Class 1B1(a)	4.18%	07/25/2039	5,589	5,685,791	0.4
Series 2019-R06, Class 2B1(a)	3.83%	09/25/2039	3,500	3,547,296	0.2
Series 2019-R07, Class 1B1(a)	3.48%	10/25/2039	4,130	4,174,842	0.3
Series 2020-R01, Class 1B1(a)	3.33%	01/25/2040	5,250	5,244,743	0.4
Series 2020-R02, Class 2B1(a)	3.08%	01/25/2040	2,000	1,992,388	0.1
Series 2020-SBT1, Class 1B1(a)	6.83%	02/25/2040	2,750	2,885,928	0.2
Series 2020-SBT1, Class 1M2(a)	3.73%	02/25/2040	3,250	3,359,650	0.2
Series 2020-SBT1, Class 2B1(a)	6.68%	02/25/2040	2,850	3,043,660	0.2
Series 2020-SBT1, Class 2M2(a)	3.73%	02/25/2040	5,680	5,880,449	0.4
Eagle Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M2(a)	3.38%	04/25/2029	2,000	2,019,982	0.1
Series 2020-1, Class M2(a)	2.08%	01/25/2030	5,000	4,906,205	0.3
Series 2021-1, Class M2(a)	4.50%	10/25/2033	1,000	1,060,499	0.1
Federal Home Loan Mortgage Corp.					
Series 2018-HQA2, Class B1(a)	4.33%	10/25/2048	5,750	5,998,117	0.4
Series 2018-HQA2, Class B2(a)	11.08%	10/25/2048	6,550	7,686,555	0.5
Series 2019-DNA1, Class B2(a)	10.83%	01/25/2049	3,750	4,341,550	0.3
Series 2019-DNA2, Class B2(a)	10.58%	03/25/2049	925	1,034,682	0.1
Series 2019-DNA3, Class B1(a)	3.33%	07/25/2049	2,000	2,019,699	0.1
Series 2019-DNA4, Class B2(a)	6.33%	10/25/2049	4,850	5,022,571	0.3
Series 2019-FTR2, Class B1(a)	3.08%	11/25/2048	3,250	3,174,100	0.2
Series 2019-HQA1, Class B1(a)	4.48%	02/25/2049	2,000	2,066,906	0.1
Series 2019-HQA2, Class B1(a)	4.18%	04/25/2049	2,250	2,321,704	0.2
Series 2019-HQA2, Class B2(a)	11.33%	04/25/2049	4,400	4,971,069	0.3
Series 2019-HQA3, Class B2(a)	7.58%	09/25/2049	6,150	6,449,268	0.4
Series 2019-HQA4, Class B1(a)	3.03%	11/25/2049	5,500	5,509,394	0.4
Series 2020-DNA1, Class B1(a)	2.38%	01/25/2050	4,000	3,987,076	0.3
Series 2020-DNA1, Class B2(a)	5.33%	01/25/2050	8,500	8,595,152	0.6
Series 2020-DNA2, Class B2(a)	4.88%	02/25/2050	8,651	8,634,841	0.6
Series 2020-DNA5, Class B1(a)	4.85%	10/25/2050	3,600	3,837,028	0.3
Series 2020-DNA5, Class B2(a)	11.55%	10/25/2050	3,000	3,943,549	0.3
Series 2020-DNA5, Class M2(a)	2.85%	10/25/2050	4,000	4,044,549	0.3
Series 2020-HQA1, Class B2(a)	5.18%	01/25/2050	6,000	6,041,252	0.4
Series 2020-HQA2, Class B2(a)	7.68%	03/25/2050	6,000	6,405,247	0.4
Series 2020-HQA3, Class M2(a)	3.68%	07/25/2050	14	14,601	0.0
Series 2021-DNA1, Class B1(a)	2.70%	01/25/2051	4,400	4,407,977	0.3
Series 2021-DNA1, Class B2(a)	4.80%	01/25/2051	3,000	3,029,991	0.2
Series 2021-DNA3, Class B1(a)	3.55%	10/25/2033	4,000	4,147,444	0.3
Series 2021-DNA3, Class B2(a)	6.30%	10/25/2033	1,000	1,129,536	0.1
Series 2021-DNA5, Class B1(a)	3.10%	01/25/2034	2,000	2,036,937	0.1
Series 2021-DNA5, Class B2(a)	5.55%	01/25/2034	3,000	3,113,286	0.2
Federal Home Loan Mortgage Corp. Structured Agency					
Credit Risk Debt Notes					
Series 2015-DNA1, Class B(a)	9.28%	10/25/2027	7,252	8,258,018	0.6
Series 2015-DNA1, Class M3(a)	3.38%	10/25/2027	3,548	3,606,331	0.2
Series 2015-DNA2, Class B(a)	7.63%	12/25/2027	8,867	9,605,316	0.6
Series 2015-DNA2, Class M3(a)	3.98%	12/25/2027	313	316,273	0.0
Series 2015-DNA3, Class B(a)	9.43%	04/25/2028	6,440	7,269,098	0.5
Series 2015-HQ1, Class B(a)	10.83%	03/25/2025	3,373	3,362,772	0.2
Series 2015-HQ2, Class B(a)	8.03%	05/25/2025	2,885	2,991,391	0.2
Series 2015-HQA1, Class B(a)	8.88%	03/25/2028	3,459	3,750,651	0.3
Series 2015-HQA2, Class B(a)	10.58%	05/25/2028	3,603	4,048,076	0.3
Series 2016-DNA1, Class B(a)	10.08%	07/25/2028	1,918	2,149,436	0.1
Series 2016-DNA1, Class M3(a)	5.63%	07/25/2028	688	718,959	0.0
Series 2016-DNA2, Class B(a)	10.58%	10/25/2028	6,759	7,835,655	0.5
Series 2016-DNA2, Class M3(a)	4.73%	10/25/2028	678	704,018	0.0
Series 2016-DNA3, Class B(a)	11.33%	12/25/2028	1,485	1,733,148	0.1
Series 2016-DNA4, Class B(a)	8.68%	03/25/2029	991	1,061,576	0.1
Series 2016-HQA1, Class B(a)	12.83%	09/25/2028	2,490	3,022,883	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Series 2016-HQA1, Class M3(a)	6.43%	09/25/2028	USD 2,723	\$ 2,852,993	0.2%
Series 2016-HQA2, Class B(a)	11.58%	11/25/2028	498	576,407	0.0
Series 2016-HQA2, Class M3B(a)	5.23%	11/25/2028	1,220	1,282,280	0.1
Series 2016-HQA3, Class B(a)	9.08%	03/25/2029	1,491	1,580,109	0.1
Series 2017-DNA1, Class B1(a)	5.03%	07/25/2029	4,000	4,310,160	0.3
Series 2017-DNA2, Class B1(a)	5.23%	10/25/2029	1,000	1,092,545	0.1
Series 2017-DNA3, Class B1(a)	4.53%	03/25/2030	15,930	16,825,682	1.1
Series 2017-HQA2, Class B1(a)	4.83%	12/25/2029	4,165	4,460,788	0.3
Series 2017-HQA2, Class M2B(a)	2.73%	12/25/2029	3,263	3,331,895	0.2
Series 2017-HQA3, Class B1(a)	4.53%	04/25/2030	4,250	4,462,595	0.3
Series 2018-SPI1, Class B(b)	3.73%	02/25/2048	1,250	1,194,389	0.1
Series 2018-SPI2, Class B(b)	3.81%	05/25/2048	2,577	2,455,256	0.2
Series 2018-SPI3, Class B(b)	4.15%	08/25/2048	920	909,156	0.1
Series 2018-SPI4, Class B(b)	4.49%	11/25/2048	2,185	2,153,280	0.1
Series 2021-DNA2, Class B1(a)	3.45%	08/25/2033	2,000	2,063,052	0.1
Series 2021-DNA2, Class B2(a)	6.05%	08/25/2033	1,250	1,378,235	0.1
Series 2021-DNA2, Class M2(a)	2.35%	08/25/2033	4,000	4,091,449	0.3
Series 2021-DNA5, Class M2(a)	1.70%	01/25/2034	4,000	4,026,046	0.3
Federal National Mortgage Association Connecticut					
Avenue Securities					
Series 2013-C01, Class M2(a)	5.33%	10/25/2023	694	722,693	0.1
Series 2014-C04, Class 1M2(a)	4.98%	11/25/2024	675	694,159	0.0
Series 2015-C03, Class 1M2(a)	5.08%	07/25/2025	1,246	1,275,772	0.1
Series 2015-C04, Class 1M2(a)	5.78%	04/25/2028	6,131	6,449,113	0.4
Series 2015-C04, Class 2M2(a)	5.63%	04/25/2028	2,890	3,031,614	0.2
Series 2016-C01, Class 1B(a)	11.83%	08/25/2028	2,690	3,040,420	0.2
Series 2016-C01, Class 2M2(a)	7.03%	08/25/2028	780	821,731	0.1
Series 2016-C02, Class 1B(a)	12.33%	09/25/2028	6,068	7,062,940	0.5
Series 2016-C02, Class 1M2(a)	6.08%	09/25/2028	1,239	1,296,736	0.1
Series 2016-C03, Class 1B(a)	11.83%	10/25/2028	3,478	4,020,979	0.3
Series 2016-C03, Class 2B(a)	12.83%	10/25/2028	3,225	3,912,887	0.3
Series 2016-C03, Class 2M2(a)	5.98%	10/25/2028	670	702,607	0.0
Series 2016-C04, Class 1B(a)	10.33%	01/25/2029	3,219	3,634,628	0.2
Series 2016-C05, Class 2B(a)	11.24%	01/25/2029	4,915	5,379,239	0.4
Series 2016-C06, Class 1B(a)	9.33%	04/25/2029	5,051	5,558,045	0.4
Series 2016-C07, Class 2B(a)	9.58%	05/25/2029	3,561	3,939,265	0.3
Series 2017-C02, Class 2B1(a)	5.58%	09/25/2029	10,313	11,254,188	0.8
Series 2017-C02, Class 2M2C(a)	3.73%	09/25/2029	5,000	5,196,523	0.3
Series 2017-C03, Class 1B1(a)	4.93%	10/25/2029	1,000	1,085,040	0.1
Series 2017-C03, Class 1M2(a)	3.08%	10/25/2029	885	909,117	0.1
Series 2017-C03, Class 1M2C(a)	3.08%	10/25/2029	2,555	2,637,533	0.2
Series 2017-C04, Class 2B1(a)	5.13%	11/25/2029	2,000	2,186,588	0.1
Series 2017-C04, Class 2M2(a)	2.93%	11/25/2029	321	327,682	0.0
Series 2017-C06, Class 1B1(a)	4.23%	02/25/2030	480	497,385	0.0
Series 2017-C06, Class 2B1(a)	4.53%	02/25/2030	3,950	4,123,566	0.3
Series 2017-C07, Class 1B1(a)	4.08%	05/25/2030	5,415	5,610,378	0.4
Series 2017-C07, Class 1M2C(a)	2.48%	05/25/2030	5,894	5,961,088	0.4
Series 2017-C07, Class 2B1(a)	4.53%	05/25/2030	2,736	2,845,022	0.2
Series 2018-C01, Class 1B1(a)	3.63%	07/25/2030	7,000	7,166,261	0.5
Series 2018-C02, Class 2B1(a)	4.08%	08/25/2030	3,750	3,891,132	0.3
Series 2018-C04, Class 2B1(a)	4.58%	12/25/2030	3,500	3,678,882	0.2
Series 2018-C05, Class 1B1(a)	4.33%	01/25/2031	4,000	4,182,695	0.3
Home Re Ltd.					
Series 2020-1, Class M2(a)	5.33%	10/25/2030	1,000	1,030,779	0.1
Series 2021-1, Class M1C(a)	2.38%	07/25/2033	8,000	7,948,907	0.5
Series 2021-1, Class M2(a)	2.93%	07/25/2033	5,000	4,901,195	0.3
Mortgage Insurance-Linked Notes					
Series 2019-1, Class M2(a)	2.98%	11/26/2029	8,500	8,499,993	0.6
Series 2021-3, Class M1B(a)	2.95%	02/25/2034	4,500	4,500,000	0.3
Oaktown Re II Ltd., Series 2018-1A, Class M2(a)	2.93%	07/25/2028	2,482	2,509,101	0.2
Oaktown Re V Ltd., Series 2020-2A, Class M2(a)	5.33%	10/25/2030	3,500	3,682,942	0.2
PMT Credit Risk Transfer Trust					
Series 2019-1R, Class A(a)	2.09%	03/27/2024	2,358	2,354,409	0.2
Series 2019-2R, Class A(a)	2.84%	05/27/2023	7,426	7,359,092	0.5
Series 2019-3R, Class A(a)	2.79%	10/27/2022	1,689	1,693,513	0.1
Radnor Re Ltd.					
Series 2019-1, Class M1B(a)	2.03%	02/25/2029	4,470	4,472,399	0.3
Series 2020-1, Class M2A(a)	2.08%	01/25/2030	1,000	1,000,000	0.1
STACR Trust					
Series 2018-DNA3, Class B1(a)	3.98%	09/25/2048	2,550	2,658,963	0.2
Series 2018-DNA3, Class B2(a)	7.83%	09/25/2048	6,015	6,547,930	0.4
TMIR, Series 2021-3, Class M2(a)	3.80%	02/25/2034	4,500	4,500,000	0.3

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Triangle Re Ltd.					
Series 2020-1, Class M2(a)	5.68%	10/25/2030	USD 3,000	\$ 3,097,599	0.2%
Series 2021-1, Class M1B(a)	3.08%	08/25/2033	3,256	3,282,984	0.2
Series 2021-1, Class M2(a)	3.98%	08/25/2033	5,000	5,060,717	0.3
				510,693,318	34.2
VARIABLE VERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 3928, Class SE(a) (c)	6.48%	09/15/2041	4,723	1,024,922	0.1
Series 4372, Class JS(a) (c)	6.00%	08/15/2044	8,515	1,783,471	0.1
Series 4416, Class BS(a) (c)	6.00%	12/15/2044	2,097	450,670	0.0
Series 4656, Class SK(a) (c)	5.95%	02/15/2047	2,148	461,754	0.0
Series 4719, Class JS(a) (c)	6.05%	09/15/2047	4,101	786,490	0.1
Series 4767, Class SB(a) (c)	6.10%	03/15/2048	4,557	882,213	0.1
Series 4981, Class HS(a) (c)	6.02%	06/25/2050	10,479	1,951,595	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2011-131, Class ST(a) (c)	6.46%	12/25/2041	5,278	1,129,024	0.1
Series 2012-122, Class MS(a) (c)	6.02%	11/25/2042	2,183	514,814	0.0
Series 2013-15, Class SA(a) (c)	6.07%	03/25/2043	4,927	1,116,183	0.1
Series 2014-40, Class HS(a) (c)	6.62%	07/25/2044	2,970	801,205	0.1
Series 2015-90, Class SL(a) (c)	6.07%	12/25/2045	5,726	1,191,055	0.1
Series 2016-106, Class ES(a) (c)	5.92%	01/25/2047	2,023	407,841	0.0
Series 2016-69, Class DS(a) (c)	6.02%	10/25/2046	9,792	1,648,739	0.1
Series 2017-20, Class SJ(a) (c)	6.02%	04/25/2047	5,252	1,202,430	0.1
Series 2017-97, Class LS(a) (c)	6.12%	12/25/2047	6,375	1,630,021	0.1
Series 2017-97, Class SW(a) (c)	6.12%	12/25/2047	6,127	1,419,347	0.1
Series 2018-28, Class SB(a) (c)	6.12%	05/25/2048	5,559	1,226,653	0.1
Series 2018-30, Class SA(a) (c)	6.12%	05/25/2048	4,434	887,298	0.1
Series 2018-58, Class SA(a) (c)	6.12%	08/25/2048	2,745	508,483	0.0
Government National Mortgage Association					
Series 2014-181, Class TV(a) (c)	6.15%	02/16/2035	4,554	599,240	0.0
Series 2015-3, Class DS(a) (c)	5.51%	11/20/2041	4,518	433,554	0.0
Series 2019-61, Class NS(a) (c)	6.01%	02/20/2049	15,853	2,539,027	0.2
Series 2020-31, Class KS(a) (c)	6.01%	03/20/2050	12,259	2,283,517	0.1
				26,879,546	1.8
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE					
Federal Home Loan Mortgage Corp. REMICs					
Series 4973, Class BI(d)	4.50%	05/25/2050	8,538	1,607,136	0.1
Series 5011, Class MI(d)	3.00%	09/25/2050	7,679	1,163,541	0.1
Series 5015, Class BI(d)	4.00%	09/25/2050	14,175	2,468,335	0.2
Series 5015, Class DI(d)	4.00%	09/25/2050	9,350	1,401,098	0.1
Series 5030, Class EI(d)	3.50%	10/25/2050	14,655	2,605,240	0.2
Series 5040, Class AI(d)	3.50%	11/25/2050	3,335	526,098	0.0
Series 5040, Class CI(d)	4.00%	11/25/2050	13,346	1,734,455	0.1
Series 5043, Class IO(d)	5.00%	11/25/2050	11,872	2,210,946	0.1
Series 5049, Class CI(d)	3.50%	12/25/2050	17,963	2,299,919	0.1
Series 5080, Class IJ(d)	4.00%	12/25/2050	9,794	1,417,694	0.1
Federal National Mortgage Association REMICs					
Series 2015-30, Class EI(d)	5.00%	05/25/2045	648	102,663	0.0
Series 2016-64, Class BI(d)	5.00%	09/25/2046	5,963	953,399	0.1
Series 2020-78, Class IO(d)	2.50%	11/25/2050	9,407	976,007	0.1
Series 2020-89, Class KI(d)	4.00%	12/25/2050	15,188	2,236,978	0.1
Series 2021-18, Class IT(d)	3.00%	04/25/2051	11,022	1,136,898	0.1
Government National Mortgage Association,					
Series 2021-117, Class MI(d)	3.50%	05/20/2042	19,441	2,439,427	0.2
				25,279,834	1.7
NICHT STAATLICH FESTVERZINSLICH					
Alternative Loan Trust					
Series 2005-50CB, Class 1A1	5.50%	11/25/2035	1,130	1,080,462	0.1
Series 2006-11CB, Class 1A2	6.00%	05/25/2036	919	728,368	0.1
Series 2006-28CB, Class A14	6.25%	10/25/2036	444	328,593	0.0
Series 2006-28CB, Class A18	6.00%	10/25/2036	751	540,770	0.0
Angel Oak Mortgage Trust, Series 2021-2,					
Class A1	0.99%	04/25/2066	6,283	6,307,523	0.4
BCAP LLC Trust, Series 2008-IND2, Class A2					
	3.03%	04/25/2038	870	809,715	0.1
Chase Mortgage Finance Trust, Series 2007-S5, Class 1A17					
	6.00%	07/25/2037	1,741	1,165,499	0.1
CitiMortgage Alternative Loan Trust,					
Series 2007-A6, Class 1A11	6.00%	06/25/2037	128	128,560	0.0
Countrywide Home Loan Mortgage Pass-Through Trust,					
Series 2006-10, Class 1A8	6.00%	05/25/2036	1,285	873,225	0.1
First Horizon Alternative Mortgage Securities Trust					
Series 2005-FA8, Class 1A12	5.50%	11/25/2035	109	77,952	0.0
Series 2006-FA2, Class 1A3	6.00%	05/25/2036	197	125,998	0.0

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Morgan Stanley Mortgage Loan Trust, Series 2006-7, Class 4A4	6.00%	06/25/2036	USD 500	\$ 376,734	0.0%
				<u>12,543,399</u>	<u>0.9</u>
NICHT STAATLICH VARIABEL VERZINSLICH					
Alternative Loan Trust, Series 2005-19CB, Class A2(a)	16.75%	06/25/2035	81	90,152	0.0
Bear Stearns Asset Backed Securities I Trust Series 2005-AC7, Class A2(a)	18.35%	10/25/2035	267	248,187	0.0
Series 2005-AC9, Class A4(a)	18.24%	12/25/2035	291	236,447	0.0
Chase Mortgage Finance Corp. Series 2016-SH1, Class M4(b)	3.75%	04/25/2045	1,555	1,549,925	0.1
Series 2016-SH2, Class M4(b)	3.75%	12/25/2045	577	585,493	0.0
CSFB Mortgage-Backed Pass-Through Certificates, Series 2005-9, Class 4A1(a)	19.29%	10/25/2035	73	92,073	0.0
Lehman Mortgage Trust, Series 2007-1, Class 3A2(a) (c)	7.17%	02/25/2037	884	220,964	0.0
RALI Trust, Series 2006-QO3, Class A1(a)	0.50%	04/25/2046	2,510	956,842	0.1
SASC, Series 2006-11, Class A3(a)	0.22%	10/28/2035	7,711	5,278,461	0.4
				<u>9,258,544</u>	<u>0.6</u>
				<u>584,654,641</u>	<u>39.2</u>
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
522 Funding CLO, Series 2021-7A, Class A(a)	1.27%	04/23/2034	7,000	7,006,860	0.5
AGL CLO 12 Ltd., Series 2021-12A, Class A1(a)	1.29%	07/20/2034	5,000	5,003,605	0.3
AGL CLO Ltd. Series 2020-9A, Class D(a)	3.83%	01/20/2034	4,000	4,027,316	0.3
Series 2021-10A, Class A(a)	1.32%	04/15/2034	3,000	3,002,415	0.2
Series 2021-10A, Class D(a)	3.09%	04/15/2034	3,500	3,502,614	0.2
Series 2021-10A, Class E(a)	6.19%	04/15/2034	2,250	2,250,207	0.2
Series 2021-11A, Class D(a)	3.31%	04/15/2034	3,000	3,002,772	0.2
Series 2021-11A, Class E(a)	6.52%	04/15/2034	1,000	1,003,442	0.1
Series 2021-12A, Class E(a)	6.28%	07/20/2034	3,250	3,171,200	0.2
Apidos CLO Series 2020-33A, Class B(a)	2.33%	07/24/2031	4,700	4,700,000	0.3
Series 2020-34A, Class D(a)	3.73%	01/20/2033	1,000	1,003,266	0.1
Series 2020-34A, Class E(a)	7.38%	01/20/2033	2,500	2,507,925	0.2
Series 2021-35A, Class A(a)	1.25%	04/20/2034	3,000	3,002,922	0.2
Series 2021-35A, Class D(a)	2.85%	04/20/2034	3,500	3,501,522	0.2
Apidos CLO XXVI, Series 2017-26A, Class D(a)	6.23%	07/18/2029	1,500	1,459,412	0.1
Apidos CLO XXXV, Series 2021-35A, Class E(a)	5.95%	04/20/2034	3,250	3,254,930	0.2
ASSURANT CLO I Ltd. Series 2017-1A, Class A(a)	1.38%	10/20/2029	5,000	5,004,290	0.3
Series 2017-1A, Class E(a)	6.59%	10/20/2029	1,000	986,580	0.1
Bain Capital Credit CLO Ltd. Series 2019-2A, Class E(a)	6.88%	10/17/2032	2,100	2,096,810	0.1
Series 2021-4A, Class A1(a)	1.29%	10/20/2034	10,000	10,000,000	0.7
Series 2021-4A, Class D(a)	3.22%	10/20/2034	5,000	5,000,000	0.3
Ballyrock CLO 16 Ltd., Series 2021-16A, Class A1(a)	1.26%	07/20/2034	5,000	5,003,705	0.3
Ballyrock CLO Ltd. Series 2018-1A, Class D(a)	5.93%	04/20/2031	1,000	959,846	0.1
Series 2020-14A, Class C(a)	3.73%	01/20/2034	2,000	2,007,348	0.1
Series 2020-14A, Class D(a)	7.13%	01/20/2034	2,000	2,001,964	0.1
Series 2021-16A, Class D(a)	6.38%	07/20/2034	3,500	3,439,992	0.2
Series 2021-17A, Class A1A(a)	1.27%	10/20/2034	10,000	10,000,000	0.7
Series 2021-17A, Class D(a)	6.10%	10/20/2034	2,000	1,970,000	0.1
Barings CLO Ltd., Series 2016-2A, Class ER(a)	6.63%	07/20/2028	3,325	3,322,051	0.2
Benefit Street Partners CLO Ltd. Series 2020-22A, Class D(a)	3.63%	01/20/2032	1,000	1,000,000	0.1
Series 2020-22A, Class E(a)	7.13%	01/20/2032	1,500	1,500,000	0.1
Black Diamond CLO Ltd. Series 2016-1A, Class A2AR(a)	1.88%	04/26/2031	5,000	4,982,465	0.3
Series 2019-2A, Class B(a)	3.19%	07/23/2032	4,125	4,048,894	0.3
BlueMountain Fuji US CLO Ltd., Series 2017-2A, Class D(a)	6.28%	10/20/2030	1,000	977,989	0.1
Carlyle US CLO Ltd., Series 2017-3A, Class D(a)	6.24%	07/20/2029	1,500	1,411,097	0.1
Cedar Funding IX CLO Ltd., Series 2018-9A, Class E(a)	5.48%	04/20/2031	875	852,906	0.1
Dryden CLO Ltd. Series 2018-57A, Class E(a)	5.32%	05/15/2031	1,750	1,676,063	0.1
Series 2018-64A, Class B(a)	1.53%	04/18/2031	3,800	3,800,084	0.3
Galaxy CLO Ltd., Series 2017-23A, Class B1R(a)	1.48%	04/24/2029	1,350	1,349,482	0.1

AB FCP I
Mortgage Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Goldentree Loan Management US CLO Ltd.					
Series 2020-7A, Class AR(a)	1.20%	04/20/2034	USD 5,000	\$ 5,003,265	0.3%
Series 2020-7A, Class DR(a)	3.28%	04/20/2034	1,000	1,002,397	0.1
Goldentree Loan Opportunities Ltd.,					
Series 2015-11A, Class BR2(a)	1.48%	01/18/2031	8,000	8,000,184	0.5
Golub Capital Partners LP, Series 2020-48A,					
Class A1(a)	1.44%	04/17/2033	3,600	3,605,479	0.3
Greywolf CLO VI Ltd., Series 2018-1A,					
Class A2(a)	1.76%	04/26/2031	5,000	5,000,360	0.3
Halcyon Loan Advisors Funding Ltd.,					
Series 2018-1A, Class C(a)	3.33%	07/21/2031	2,000	1,923,598	0.1
Invesco CLO Ltd.					
Series 2021-1A, Class B(a)	1.72%	04/15/2034	3,000	3,002,397	0.2
Series 2021-1A, Class E(a)	6.63%	04/15/2034	3,000	2,969,478	0.2
Jamestown CLO XI Ltd., Series 2018-11A,					
Class D(a)	6.15%	07/14/2031	1,500	1,433,343	0.1
Madison Park Funding Ltd., Series 2017-26A,					
Class AR(a)	1.32%	07/29/2030	3,000	3,000,285	0.2
Marble Point CLO XI Ltd., Series 2017-2A,					
Class A(a)	1.31%	12/18/2030	4,500	4,497,295	0.3
Milos CLO Ltd., Series 2017-1A, Class DR(a)	2.88%	10/20/2030	2,000	2,000,028	0.1
Neuberger Berman Loan Advisers CLO Ltd.					
Series 2020-39A, Class D(a)	3.73%	01/20/2032	1,250	1,254,034	0.1
Series 2020-39A, Class E(a)	7.33%	01/20/2032	2,500	2,502,590	0.2
Series 2021-42A, Class A(a)	1.24%	07/16/2035	5,000	5,001,855	0.3
Series 2021-42A, Class E(a)	6.09%	07/16/2035	3,625	3,624,663	0.3
Series 2021-43A, Class A(a)	1.24%	07/17/2035	7,000	7,003,906	0.5
Series 2021-43A, Class D(a)	3.21%	07/17/2035	3,000	3,002,118	0.2
Series 2021-44A, Class E(a)	6.12%	10/16/2034	1,500	1,500,000	0.1
New Mountain CLO Ltd.					
Series CLO-2A, Class A(a)	1.39%	04/15/2034	11,000	11,008,855	0.7
Series CLO-3A, Class A(a)	1.31%	10/20/2034	10,000	10,001,040	0.7
Series CLO-3A, Class D(a)	3.48%	10/20/2034	5,000	4,999,480	0.3
OCP CLO Ltd.					
Series 2014-6A, Class DR(a)	6.65%	10/17/2030	2,000	1,987,030	0.1
Series 2018-15A, Class D(a)	5.98%	07/20/2031	1,000	992,017	0.1
Octagon Investment Partners 35 Ltd.,					
Series 2018-1A, Class D(a)	5.33%	01/20/2031	3,000	2,848,911	0.2
OZLM XXII Ltd., Series 2018-22A, Class D(a)	5.43%	01/17/2031	1,750	1,606,379	0.1
Palmer Square CLO Ltd., Series 2020-3A,					
Class C(a)	4.12%	11/15/2031	1,500	1,508,228	0.1
Peace Park CLO Ltd.,					
Series 2021-1A, Class A(a)	1.25%	10/20/2034	10,000	10,000,000	0.7
Series 2021-1A, Class E(a)	6.12%	10/20/2034	2,830	2,830,000	0.2
Pikes Peak CLO					
Series 2018-1A, Class E(a)	6.18%	07/24/2031	1,500	1,447,185	0.1
Series 2018-2A, Class E(a)	6.33%	01/18/2032	3,050	3,015,068	0.2
Series 2021-7A, Class D(a)	3.53%	02/25/2034	5,000	5,007,315	0.3
Series 2021-8A, Class A(a)	1.32%	07/20/2034	10,000	10,009,300	0.7
Series 2021-8A, Class D(a)	3.25%	07/20/2034	5,000	5,000,570	0.3
PPM CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	6.08%	07/15/2031	3,000	2,820,243	0.2
Rockford Tower CLO Ltd.					
Series 2017-2A, Class AR(a)	1.15%	10/15/2029	2,000	2,000,194	0.1
Series 2017-3A, Class B(a)	1.60%	10/20/2030	3,000	3,000,027	0.2
Series 2018-1A, Class D(a)	3.13%	05/20/2031	3,450	3,450,369	0.2
Series 2018-2A, Class B(a)	1.93%	10/20/2031	7,000	7,002,968	0.5
Series 2021-1A, Class A1(a)	1.25%	07/20/2034	7,000	7,012,117	0.5
Series 2021-1A, Class E(a)	6.44%	07/20/2034	3,000	2,931,027	0.2
Romark CLO III Ltd., Series 2019-3A, Class A2(a)	2.20%	07/15/2032	5,000	5,000,335	0.3
TCW CLO Ltd., Series 2018-1A, Class E(a)	6.18%	04/25/2031	2,250	2,195,386	0.2
TIAA CLO Ltd.					
Series 2016-1A, Class AR(a)	1.33%	07/20/2031	2,000	2,000,410	0.1
Series 2016-1A, Class B1R(a)	1.88%	07/20/2031	5,000	5,000,110	0.3
Series 2016-1A, Class CR(a)	2.48%	07/20/2031	2,000	1,996,440	0.1
Series 2016-1A, Class DR(a)	3.63%	07/20/2031	4,000	3,954,560	0.3
TRESTLES CLO Ltd., Series 2018-2A, Class A2(a)	1.80%	07/25/2031	3,000	3,000,624	0.2
Venture CLO Ltd., Series 2017-27A, Class D(a)	4.13%	07/20/2030	1,500	1,500,479	0.1
Voya CLO Ltd., Series 2016-3A, Class A1R(a)	1.32%	10/18/2031	3,000	3,002,592	0.2
				318,248,508	21.3

DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN

NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS

225 Liberty Street Trust, Series 2016-225L, Class E	4.80%	02/10/2036	2,000	2,096,678	0.1
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2013-WBRK, Class D	3.65%	03/10/2037	3,000	2,764,755	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Banc of America Commercial Mortgage Trust					
Series 2015-UBS7, Class AS	3.99%	09/15/2048	USD 1,140	\$ 1,245,115	0.1%
Series 2015-UBS7, Class XA(d)	0.94%	09/15/2048	75,638	2,048,424	0.1
Bank, Series 2018-BN14, Class XA(d)	0.66%	09/15/2060	94,392	2,633,358	0.2
CCUBS Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-C1, Class XA(d)	1.15%	11/15/2050	15,526	655,869	0.0
CD Mortgage Trust, Series 2017-CD3, Class XA(d)					
	1.14%	02/10/2050	97,730	4,271,282	0.3
CFCRE Commercial Mortgage Trust					
Series 2016-C4, Class AM	3.69%	05/10/2058	190	205,139	0.0
Series 2016-C7, Class A3	3.84%	12/10/2054	2,500	2,782,545	0.2
Citigroup Commercial Mortgage Trust					
Series 2013-GC11, Class D	4.56%	04/10/2046	1,056	1,074,701	0.1
Series 2013-GC17, Class D	5.26%	11/10/2046	2,430	2,247,509	0.2
Series 2015-GC29, Class XA(d)	1.17%	04/10/2048	6,633	213,014	0.0
Series 2016-C3, Class XA(d)	1.23%	11/15/2049	98,601	3,869,526	0.3
Series 2016-P3, Class XA(d)	1.85%	04/15/2049	42,408	2,398,080	0.2
Series 2017-C4, Class XA(d)	1.23%	10/12/2050	57,410	2,681,440	0.2
Series 2017-P8, Class XA(d)	1.04%	09/15/2050	43,772	1,963,600	0.1
Series 2018-C6, Class XA(d)	0.95%	11/10/2051	7,923	391,386	0.0
Commercial Mortgage Trust					
Series 2010-C1, Class D	5.99%	07/10/2046	2,500	2,536,425	0.2
Series 2010-C1, Class F	4.00%	07/10/2046	3,780	2,832,701	0.2
Series 2012-CR2, Class G	4.25%	08/15/2045	1,500	712,032	0.0
Series 2012-CR3, Class E	4.91%	10/15/2045	2,173	1,084,573	0.1
Series 2012-CR3, Class XA(d)	1.99%	10/15/2045	3,000	36,561	0.0
Series 2012-CR5, Class XA(d)	1.65%	12/10/2045	14,339	213,739	0.0
Series 2013-LC6, Class D	4.44%	01/10/2046	640	632,955	0.0
Series 2013-LC6, Class XA(d)	1.43%	01/10/2046	12,612	143,145	0.0
Series 2014-CR16, Class D	5.08%	04/10/2047	1,841	1,741,984	0.1
Series 2014-CR19, Class XA(d)	1.11%	08/10/2047	73,752	1,701,554	0.1
Series 2014-CR20, Class XA(d)	1.15%	11/10/2047	7,855	213,591	0.0
Series 2014-LC17, Class B	4.49%	10/10/2047	2,000	2,179,308	0.1
Series 2014-UBS2, Class D	5.17%	03/10/2047	1,250	1,253,327	0.1
Series 2014-UBS6, Class AM	4.05%	12/10/2047	190	204,560	0.0
Series 2015-CR22, Class XA(d)	1.02%	03/10/2048	16,260	369,795	0.0
Series 2015-CR27, Class XA(d)	1.06%	10/10/2048	92,633	3,062,509	0.2
Series 2015-LC19, Class XA(d)	1.26%	02/10/2048	49,867	1,573,857	0.1
Series 2015-LC21, Class XA(d)	0.82%	07/10/2048	51,290	1,128,344	0.1
Series 2016-DC2, Class XA(d)	1.11%	02/10/2049	49,770	1,723,588	0.1
CSAIL Commercial Mortgage Trust,					
Series 2017-C8, Class XA(d)	1.37%	06/15/2050	64,836	2,967,095	0.2
GS Mortgage Securities Trust					
Series 2011-GC5, Class C	5.30%	08/10/2044	4,850	4,134,625	0.3
Series 2012-GC6, Class D	6.04%	01/10/2045	3,968	3,856,337	0.3
Series 2012-GCJ7, Class A4	3.38%	05/10/2045	52	52,204	0.0
Series 2013-GC13, Class C	4.22%	07/10/2046	4,537	4,271,831	0.3
Series 2013-GC13, Class D	4.22%	07/10/2046	2,190	1,246,986	0.1
Series 2014-GC18, Class D	5.15%	01/10/2047	1,558	400,182	0.0
Series 2014-GC22, Class A5	3.86%	06/10/2047	2,500	2,692,503	0.2
Series 2014-GC22, Class XA(d)	1.10%	06/10/2047	6,633	123,674	0.0
Series 2016-GS3, Class A4	2.85%	10/10/2049	2,500	2,675,747	0.2
Series 2016-GS3, Class XA(d)	1.34%	10/10/2049	77,225	3,874,050	0.3
Series 2017-GS5, Class XA(d)	0.99%	03/10/2050	52,727	2,167,154	0.1
Series 2017-GS6, Class AS	3.64%	05/10/2050	2,000	2,197,376	0.1
Series 2017-GS7, Class XA(d)	1.26%	08/10/2050	26,817	1,337,037	0.1
Series 2017-GS8, Class XA(d)	1.11%	11/10/2050	38,318	1,710,857	0.1
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2011-C4, Class C	5.57%	07/15/2046	2,262	2,271,356	0.2
Series 2011-C5, Class D	5.71%	08/15/2046	442	421,756	0.0
Series 2012-C6, Class E	5.31%	05/15/2045	2,250	1,664,845	0.1
Series 2012-C6, Class G	2.97%	05/15/2045	2,500	1,122,332	0.1
Series 2012-C8, Class B	3.98%	10/15/2045	5,000	5,080,733	0.3
Series 2012-C8, Class C	4.78%	10/15/2045	3,000	3,037,969	0.2
Series 2012-CBX, Class C	5.08%	06/15/2045	3,000	2,875,926	0.2
Series 2013-C10, Class B	3.67%	12/15/2047	2,213	2,287,253	0.2
Series 2013-C10, Class D	4.24%	12/15/2047	1,550	1,562,982	0.1
Series 2014-C20, Class XA(d)	1.01%	07/15/2047	11,387	178,924	0.0
Series 2016-JP2, Class XA(d)	1.94%	08/15/2049	41,423	2,904,721	0.2
Series 2016-JP3, Class B	3.40%	08/15/2049	2,000	2,115,661	0.1
JPMBB Commercial Mortgage Securities Trust					
Series 2013-C14, Class D	4.70%	08/15/2046	3,425	2,596,137	0.2
Series 2013-C17, Class D	5.05%	01/15/2047	2,535	2,566,692	0.2
Series 2014-C21, Class B	4.34%	08/15/2047	2,000	2,136,021	0.1
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.98%	09/15/2047	99,474	2,114,301	0.1
Series 2014-C24, Class C	4.55%	11/15/2047	6,000	5,877,571	0.4

AB FCP I
Mortgage Income Portfolio

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
LCCM, Series 2017-LC26, Class XA(d)	1.59%	07/12/2050	USD 33,489	\$ 1,921,680	0.1%
Morgan Stanley Bank of America Merrill Lynch Trust					
Series 2012-C5, Class XA(d)	1.54%	08/15/2045	16,735	107,427	0.0
Series 2012-C6, Class E	4.76%	11/15/2045	425	405,874	0.0
Series 2012-C6, Class XA(d)	1.75%	11/15/2045	3,600	32,459	0.0
Series 2014-C18, Class C	4.65%	10/15/2047	1,333	1,387,387	0.1
Series 2014-C19, Class D	3.25%	12/15/2047	1,225	1,217,163	0.1
Series 2014-C19, Class XA(d)	1.12%	12/15/2047	27,859	738,926	0.0
Series 2015-C20, Class XA(d)	1.41%	02/15/2048	58,935	1,943,863	0.1
Series 2015-C22, Class XA(d)	1.16%	04/15/2048	47,845	1,322,690	0.1
Series 2015-C25, Class XA(d)	1.20%	10/15/2048	30,641	1,039,764	0.1
Series 2017-C34, Class XA(d)	0.92%	11/15/2052	31,095	1,195,236	0.1
Morgan Stanley Capital I Trust					
Series 2011-C3, Class C	5.46%	07/15/2049	2,500	2,497,237	0.2
Series 2016-UBS9, Class XA(d)	1.31%	03/15/2049	60,281	2,411,650	0.2
Series 2018-L1, Class XA(d)	0.68%	10/15/2051	159,694	4,976,836	0.3
UBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C1, Class D	5.74%	05/10/2045	2,576	2,451,785	0.2
Series 2017-C3, Class XA(d)	1.23%	08/15/2050	37,466	1,771,086	0.1
Series 2017-C4, Class XA(d)	1.19%	10/15/2050	20,425	1,068,665	0.1
Series 2017-C5, Class XA(d)	1.13%	11/15/2050	38,839	1,648,456	0.1
Series 2018-C10, Class XA(d)	1.11%	05/15/2051	77,084	3,888,700	0.3
Series 2018-C14, Class XA(d)	1.16%	12/15/2051	51,610	3,021,943	0.2
Series 2018-C15, Class XA(d)	1.09%	12/15/2051	30,127	1,633,728	0.1
UBS-Barclays Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-C4, Class XA(d)	1.73%	12/10/2045	12,795	153,146	0.0
Series 2013-C5, Class XA(d)	1.04%	03/10/2046	30,581	257,804	0.0
Series 2013-C6, Class D	4.45%	04/10/2046	3,618	3,163,658	0.2
Series 2013-C6, Class XA(d)	1.24%	04/10/2046	3,294	38,859	0.0
Wells Fargo Commercial Mortgage Trust					
Series 2012-LC5, Class D	4.92%	10/15/2045	380	386,321	0.0
Series 2015-C27, Class XA(d)	1.43%	02/15/2048	140,623	3,392,887	0.2
Series 2015-C29, Class C	4.36%	06/15/2048	3,852	4,148,768	0.3
Series 2015-C31, Class A3	3.43%	11/15/2048	1,272	1,347,768	0.1
Series 2015-NXS3, Class A4	3.62%	09/15/2057	1,425	1,560,400	0.1
Series 2015-SG1, Class AS	4.05%	09/15/2048	1,313	1,429,453	0.1
Series 2016-C32, Class XA(d)	1.36%	01/15/2059	57,525	2,576,288	0.2
Series 2016-C33, Class XA(d)	1.78%	03/15/2059	36,810	2,252,221	0.2
Series 2016-C35, Class A3	2.67%	07/15/2048	2,500	2,623,950	0.2
Series 2016-C35, Class B	3.44%	07/15/2048	2,500	2,643,888	0.2
Series 2016-C35, Class XA(d)	2.05%	07/15/2048	34,017	2,534,916	0.2
Series 2016-C36, Class XA(d)	1.40%	11/15/2059	50,087	2,528,971	0.2
Series 2016-LC24, Class XA(d)	1.76%	10/15/2049	26,951	1,763,994	0.1
Series 2016-LC25, Class XA(d)	1.11%	12/15/2059	77,762	2,588,659	0.2
Series 2017-C38, Class XA(d)	1.16%	07/15/2050	30,667	1,396,196	0.1
Series 2017-C39, Class A5	3.42%	09/15/2050	2,500	2,763,309	0.2
Series 2018-C48, Class A5	4.30%	01/15/2052	2,000	2,335,996	0.2
Series 2018-C48, Class XA(d)	1.11%	01/15/2052	47,933	2,751,971	0.2
WF-RBS Commercial Mortgage Trust					
Series 2011-C4, Class E	5.02%	06/15/2044	713	479,803	0.0
Series 2011-C5, Class E	5.96%	11/15/2044	2,300	2,272,797	0.2
Series 2012-C10, Class B	3.74%	12/15/2045	2,500	2,478,662	0.2
Series 2012-C10, Class XA(d)	1.64%	12/15/2045	18,615	262,823	0.0
Series 2012-C7, Class XA(d)	1.45%	06/15/2045	47,668	166,571	0.0
Series 2012-C8, Class E	5.05%	08/15/2045	2,110	2,005,966	0.1
Series 2012-C8, Class XA(d)	1.94%	08/15/2045	21,305	155,832	0.0
Series 2012-C9, Class D	4.97%	11/15/2045	615	597,219	0.0
Series 2012-C9, Class XA(d)	2.02%	11/15/2045	13,547	178,429	0.0
Series 2013-C11, Class AS	3.31%	03/15/2045	2,000	2,057,716	0.1
Series 2013-C11, Class XA(d)	1.28%	03/15/2045	16,751	201,199	0.0
Series 2014-C22, Class XA(d)	0.94%	09/15/2057	35,982	694,549	0.0
Series 2014-C24, Class AS	3.93%	11/15/2047	3,164	3,374,631	0.2
Series 2014-C25, Class D	3.80%	11/15/2047	1,290	1,190,969	0.1
Series 2014-C25, Class XA(d)	0.95%	11/15/2047	22,693	526,074	0.0
				229,375,025	15.3
NICHT STAATLICHE VARIABLE VERZINSLICHE CMBS					
Ashford Hospitality Trust, Series 2018-KEYS, Class A(a)	1.10%	06/15/2035	3,000	3,003,046	0.2
BAMLL Commercial Mortgage Securities Trust,					
Series 2017-SCH, Class AF(a)	1.10%	11/15/2033	3,000	2,938,160	0.2
Braemar Hotels & Resorts Trust, Series 2018-PRME,					
Class A(a)	0.92%	06/15/2035	5,000	5,000,964	0.3
BX Trust, Series 2018-EXCL, Class A(a)	1.18%	09/15/2037	5,442	5,442,706	0.4
DBWF Mortgage Trust, Series 2018-GLKS, Class E(a)	3.10%	12/19/2030	2,420	2,414,205	0.2

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2021-MN1, Class M2(a)	3.80%	01/25/2051	USD 1,700	\$ 1,793,272	0.1%
Invitation Homes Trust, Series 2018-SFR3, Class A(a)	1.09%	07/17/2037	4,518	4,525,394	0.3
Morgan Stanley Capital I Trust Series 2019-BPR, Class D(a)	4.10%	05/15/2036	2,750	1,983,869	0.1
Series 2019-BPR, Class E(a)	4.85%	05/15/2036	2,250	1,494,769	0.1
Starwood Retail Property Trust, Series 2014-STAR, Class A(a)	1.57%	11/15/2027	990	661,070	0.1
				<u>29,257,455</u>	<u>2.0</u>
STAATLICHE CMBS					
Federal Home Loan Mortgage Corp. Series K076, Class A2	3.90%	04/25/2028	3,500	4,070,150	0.3
Series K085, Class A2	4.06%	10/25/2028	7,844	9,231,781	0.6
Series K090, Class A2	3.42%	02/25/2029	3,055	3,489,901	0.2
				<u>16,791,832</u>	<u>1.1</u>
				<u>275,424,312</u>	<u>18.4</u>
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Affirm Asset Securitization Trust, Series 2020-A, Class A	2.10%	02/18/2025	2,500	2,515,790	0.2
CLUB Credit Trust, Series 2017-P2, Class C	4.91%	01/15/2024	331	332,505	0.0
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I, Series 2019-HP1, Class B	3.48%	12/15/2026	2,800	2,854,452	0.2
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust Series 2018-P1, Class C	5.21%	07/15/2025	892	904,820	0.1
Series 2018-P2, Class C	5.21%	10/15/2025	775	787,929	0.1
Hardee's Funding LLC, Series 2020-1A, Class A2	3.98%	12/20/2050	2,985	3,191,829	0.2
Marlette Funding Trust, Series 2018-4A, Class C	4.91%	12/15/2028	3,000	3,019,552	0.2
Navient Private Education Loan Trust, Series 2014-AA, Class A2A	2.74%	02/15/2029	4,644	4,708,210	0.3
Neighborly Issuer LLC, Series 2021-1A, Class A2	3.58%	04/30/2051	4,988	5,164,905	0.3
OneMain Financial Issuance Trust, Series 2021-1A, Class B	1.95%	06/16/2036	4,000	4,032,284	0.3
SMB Private Education Loan Trust Series 2021-A, Class A2B	1.59%	01/15/2053	5,000	5,032,185	0.3
Series 2021-B, Class A	1.31%	07/17/2051	6,554	6,562,198	0.4
SoFi Consumer Loan Program LLC Series 2016-2, Class B	4.77%	10/27/2025	421	421,970	0.0
Series 2017-3, Class B	3.85%	05/25/2026	511	513,389	0.0
Series 2017-4, Class B	3.59%	05/26/2026	2,115	2,122,928	0.1
Series 2017-6, Class C	4.02%	11/25/2026	2,250	2,279,117	0.2
SoFi Consumer Loan Program Trust Series 2018-1, Class C	3.97%	02/25/2027	2,500	2,547,319	0.2
Series 2018-2, Class C	4.25%	04/26/2027	2,500	2,560,502	0.2
Series 2018-3, Class C	4.67%	08/25/2027	2,500	2,569,415	0.2
Zaxby's Funding LLC, Series 2021-1A, Class A2	3.24%	07/30/2051	2,200	2,265,150	0.2
				<u>54,386,449</u>	<u>3.7</u>
AUTOS – FESTVERZINSLICH					
Avis Budget Rental Car Funding AESOP LLC Series 2020-1A, Class D	3.34%	08/20/2026	5,000	4,990,680	0.3
Series 2021-1A, Class D	3.71%	08/20/2027	5,000	5,049,590	0.3
CPS Auto Receivables Trust Series 2016-B, Class E	8.14%	05/15/2023	1,410	1,413,217	0.1
Series 2016-C, Class E	8.39%	09/15/2023	1,818	1,822,890	0.1
Series 2018-A, Class D	3.66%	12/15/2023	968	977,866	0.1
Flagship Credit Auto Trust Series 2016-4, Class E	6.44%	01/16/2024	1,000	1,002,004	0.1
Series 2019-4, Class E	4.11%	03/15/2027	3,000	3,171,665	0.2
Series 2020-1, Class D	2.48%	03/16/2026	5,000	5,148,760	0.4
Foursight Capital Automobile Receivables Trust, Series 2020-1, Class D	2.60%	01/15/2026	2,080	2,134,526	0.1
				<u>25,711,198</u>	<u>1.7</u>
SONSTIGE VARIABEL VERZINSLICHE ABS					
SLM Private Credit Student Loan Trust, Series 2005-A, Class A4(a)	0.43%	12/15/2038	3,234	3,183,943	0.2
SMB Private Education Loan Trust Series 2014-A, Class A3(a)	1.60%	04/15/2032	3,199	3,227,184	0.2
Series 2020-PTB, Class A2B(a)	0.93%	09/15/2054	4,626	4,692,457	0.3
SoFi Professional Loan Program LLC, Series 2015-D, Class A1(a)	1.58%	10/27/2036	4,237	4,254,811	0.3
				<u>15,358,395</u>	<u>1.0</u>

	Zinssatz	Datum	Nennwert (000)	Wert (USD)	Nettover- mögen %	
BAUSPARDARLEHEN – FESTVERZINSLICH						
Citigroup Mortgage Loan Trust, Inc., Series 2005-WF1, Class A5	5.01%	11/25/2034	USD	0* \$ 108	0.0%	
				95,456,150	6.4	
HYPOTHEKEN MIT LAUFENDEN ZINSZAHLUNGEN						
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 30-JÄHRIGER LAUFZEIT						
Federal Home Loan Mortgage Corp., Series 2020	2.50%	06/01/2050		9,864	10,336,686	0.7
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold						
Series 2016	4.50%	02/01/2046		4,273	4,739,320	0.3
Series 2017	4.50%	06/01/2047		4,103	4,525,978	0.3
Series 2018	4.00%	10/01/2048		6,223	6,761,768	0.5
Series 2018	4.50%	10/01/2048		1,807	1,986,988	0.1
Series 2018	5.00%	09/01/2048		2,195	2,442,788	0.2
Series 2018	5.00%	11/01/2048		1,043	1,161,097	0.1
Federal National Mortgage Association						
Series 2000	7.50%	10/01/2030		3	3,722	0.0
Series 2001	7.50%	06/01/2031		26	31,560	0.0
Series 2003	5.00%	11/01/2033		177	198,788	0.0
Series 2004	8.00%	09/01/2033		421	490,817	0.0
Series 2008	5.00%	07/01/2037		188	210,674	0.0
Series 2008	5.50%	05/01/2038		229	266,292	0.0
Series 2009	5.00%	05/01/2039		97	110,552	0.0
Series 2010	5.00%	02/01/2040		580	659,062	0.1
Series 2010	5.00%	04/01/2040		804	914,571	0.1
Series 2010	5.00%	12/01/2040		834	947,647	0.1
Series 2011	5.00%	04/01/2041		374	428,065	0.0
Series 2014	5.00%	08/01/2044		1,034	1,191,247	0.1
Series 2016	4.50%	04/01/2046		3,719	4,124,903	0.3
Series 2017	4.50%	10/01/2047		3,438	3,790,396	0.3
Series 2018	4.50%	09/01/2048		1,391	1,530,479	0.1
Government National Mortgage Association						
Series 2009	5.00%	10/15/2039		180	205,630	0.0
Series 2012	5.50%	06/15/2038		57	65,249	0.0
Series 2014	5.00%	08/20/2041		504	565,209	0.0
Series 2020	2.50%	09/01/2051		11,650	12,082,324	0.8
Uniform Mortgage-Backed Security						
Series 2021, TBA.	1.50%	09/01/2051		8,240	8,100,950	0.5
Series 2021, TBA.	2.50%	09/01/2051		15,000	15,583,593	1.0
				83,456,355	5.6	
FESTVERZINSLICHE STAATSPAPIERE MIT 15-JÄHRIGER LAUFZEIT						
Federal Home Loan Mortgage Corp. Gold						
Series 2011	5.00%	07/01/2025		74	76,576	0.0
Series 2011	6.50%	03/01/2026		6	6,185	0.0
Series 2012	5.00%	06/01/2026		2	2,541	0.0
Series 2014	3.50%	02/01/2029		569	608,502	0.0
				693,804	0.0	
				84,150,159	5.6	
				1,357,933,770	90.9	
GELDMARKTINSTRUMENTE						
US-SCHATZWECHSEL						
U.S. Treasury Bill	0.00%	10/28/2021		25,835	25,832,750	1.7
				1,383,766,520	92.6	
SONSTIGE ÜBERTRAGBARE WERTPAPIERE						
BESICHERTE HYPOTHEKENVERPFLICHTUNGEN						
RISIKOTEILUNG – VARIABEL VERZINSLICH						
Bellemeade Re Ltd., Series 2020-4A, Class B1(a)	5.08%	06/25/2030		500	509,655	0.0
Federal Home Loan Mortgage Corp.						
Series 2019-FTR2, Class B2(a)	7.48%	11/25/2048		2,500	2,549,298	0.2
Series 2019-FTR3, Class B2(a)	4.89%	09/25/2047		7,980	7,929,846	0.5
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust						
Series 2014-CH1, Class M2(a)	4.33%	11/25/2024		857	844,413	0.1
Series 2015-CH1, Class M2(a)	5.58%	10/25/2025		1,959	1,856,891	0.1
PMT Credit Risk Transfer Trust, Series 2020-1R,						
Class A(a)	2.44%	02/27/2023		2,333	2,330,235	0.2
Triangle Re Ltd., Series 2021-1, Class B1(a)	4.58%	08/25/2033		2,000	2,007,249	0.1
Wells Fargo Credit Risk Transfer Securities Trust,						
Series 2015-WF1, Class 1M2(a)	5.33%	11/25/2025		899	870,183	0.1
				18,897,770	1.3	

	Zinssatz	Datum	Anteile/Nennwert (-)/(000)	Wert (USD)	Nettovermögen %
ABS-ANLEIHEN					
SONSTIGE FESTVERZINSLICHE ABS					
Consumer Loan Underlying Bond Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-20, Class PT	11.71%	11/16/2043	USD 334	\$ 336,126	0.0%
Series 2018-7, Class PT	11.25%	06/15/2043	96	94,358	0.0
Series 2019-24, Class PT	10.35%	08/15/2044	1,251	1,254,341	0.1
Series 2019-44, Class PT	11.87%	11/15/2044	1,095	1,107,893	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Club Certificate Issuer Trust I					
Series 2018-12, Class PT	10.00%	06/15/2043	216	214,789	0.0
Series 2018-4, Class PT	12.10%	05/15/2043	86	85,610	0.0
Series 2019-48, Class PT	10.94%	12/15/2044	1,032	1,040,947	0.1
Consumer Loan Underlying Bond Credit Trust					
Series 2018-3, Class PT			94,197	92,591	0.0
SMB Private Education Loan Trust Series 2021-A, Class R			2,992	9,595,344	0.6
SoFi Consumer Loan Program LLC					
Series 2016-1, Class R(e)	0.00%	08/25/2025	319	152,347	0.0
Series 2017-5, Class R1(e)	0.00%	09/25/2026	14	299,460	0.0
SoFi Consumer Loan Program Trust Series 2018-1, Class R1 (e)			25,182	670,637	0.1
				<u>14,944,443</u>	<u>1.0</u>
DURCH GEWERBLICHE HYPOTHEKEN BESICHERTE ANLEIHEN					
NICHT STAATLICHE FESTVERZINSLICHE CMBS					
Grantor Trust COMM, Series 2014-UBS2(e)	0.00%	03/10/2047	14	258,657	0.0
Grantor Trust CSAIL, Series 2015-C1(e)	4.00%	04/15/2050	226	3,509,001	0.3
Grantor Trust JPMBB, Series 2014-C24(e)	4.00%	11/15/2047	210	2,590,626	0.1
Grantor Trust WFRBS, Series 2014-C23(e)	3.40%	10/15/2057	217	3,332,779	0.3
GS Mortgage Securities Trust, Series 2011-GC5, Class D	5.30%	08/10/2044	493	252,443	0.0
JP Morgan Chase Commercial Mortgage Securities Trust, Series 2012-C8, Class E	4.83%	10/15/2045	1,645	1,443,574	0.1
Morgan Stanley Capital I Trust, Series 2019-BPR, Class XCP(d)	0.15%	10/15/2020	163,600	1,636	0.0
				<u>11,388,716</u>	<u>0.8</u>
STAMMAKTIE					
Mt. Logan Re Ltd., (Preference Shares) (Series 1)(e)			4,000	4,077,322	0.3
BESICHERTE KREDITVERPFLICHTUNGEN					
CLO – VARIABEL VERZINSLICH					
Eaton Vance CLO Ltd., Series 2014-1RA, Class D(a)	3.18%	07/15/2030	USD 1,500	1,499,070	0.1
SCHWELLENMÄRKTE – INDUSTRIESCHULDVERSCHREIBUNGEN					
INDUSTRIE					
NICHT KONJUNKTURABHÄNGIGE KONSUMGÜTER					
Virgolino de Oliveira Finance SA(f)	10.88%	01/13/2020	1,665	208,125	0.0
				<u>51,015,446</u>	<u>3.5</u>
Gesamtanlagen					
(Kosten \$1,563,246,216)				\$ 1,434,781,966	96.1%
Termineinlagen					
BBH, Grand Cayman(g)	(0.78)%	–		1	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	(0.13)%	–		251	0.0
BNP Paribas, Paris(g)	4.00 %	–		14,139	0.0
National Australia Bank, London(g)	0.01 %	–		124,897,144	8.3
Termineinlagen insgesamt				<u>124,911,535</u>	<u>8.3</u>
Sonstige Vermögenswerte abzüglich Verbindlichkeiten				<u>(65,920,588)</u>	<u>(4.4)</u>
Nettovermögen				<u>\$ 1,493,772,913</u>	<u>100.0%</u>

DEWISENTERMINGESCHÄFTE

Gegenpartei	Verträge zur Lieferung (000)	Im Austausch gegen (000)	Ausübungs- datum	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,223	CNH 14,532	09/08/2021	\$ 28,808
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,223	CNH 14,465	09/13/2021	16,343
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,050	EUR 4,296	09/13/2021	23,004
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 42,693	AUD 58,938	10/01/2021	430,346
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 5,251	EUR 4,470	10/01/2021	29,640
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 272	GBP 198	10/01/2021	747
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 2,932	SGD 3,963	10/01/2021	16,205
Brown Brothers Harriman & Co.+	USD 10,127	ZAR 151,664	10/01/2021	271,248
				<u>\$ 816,341</u>

+ Zum Zweck der Absicherung von Anteilsklassen benutzt.

ZENTRAL ABGERECHNETE ZINSSWAPS

Clearing-Broker/(Börse)	Nominal- betrag (000)	Abschluss- datum	Zinsart		Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
			Vom Fonds geleistete Zahlungen	Vom Fonds erhaltene Zahlungen	
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	USD 7,950	05/27/2030	3 Month LIBOR	0.645%	\$ (412,573)
Morgan Stanley & Co. LLC/(CME Group)	5,800	07/27/2031	3 Month LIBOR	1.321%	(8,400)
Morgan Stanley & Co., LLC/(LCH Group)	75,000	03/31/2025	0.524%	3 Month LIBOR	295,254
Insgesamt					<u>\$ (125,719)</u>
				Wertsteigerung	\$ 295,254
				Wertminderung	\$ (420,973)

CREDIT-DEFAULT-SWAPS

Gegenpartei	Referenz-Obligation	Abschluss- datum	Nominal- betrag (000)	Marktwert	Vorab- gebühren bezahlt/ (erhalten)	Unrealisierte Wertsteigerung/ (-minderung)
Verkaufskontrakte						
Citigroup Global Markets, Inc	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	USD 2,576	\$ (1,138,687)	\$ (303,987)	\$ (834,700)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	423	(187,076)	(65,317)	(121,759)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	663	(293,000)	(101,910)	(191,090)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,514	(1,111,351)	(377,591)	(733,760)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,000	(547,400)	(243,809)	(303,591)
Citigroup Global Markets, Inc.	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	3,000	(821,100)	(322,699)	(498,401)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	966	(427,114)	(112,796)	(314,318)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	804	(220,055)	(63,992)	(156,063)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,000	(547,400)	(271,376)	(276,024)
Credit Suisse International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,500	(684,250)	(139,046)	(545,204)
Goldman Sachs International	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,500	(684,250)	(153,895)	(530,355)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,060	(468,544)	(199,110)	(269,434)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,093	(483,066)	(202,341)	(280,725)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,126	(498,015)	(212,949)	(285,066)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,713	(757,274)	(321,767)	(435,507)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,932	(854,229)	(405,374)	(448,855)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,898	(1,281,343)	(432,660)	(848,683)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,057	(563,001)	(268,342)	(294,659)
JPMorgan Securities, LLC	CDX-CMBX.NA.BBB- Series 6	05/11/2063	2,500	(684,250)	(272,676)	(411,574)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	1,289	(569,770)	(153,074)	(416,696)
Morgan Stanley & Co. International PLC	CDX-CMBX.NA.BB Series 6	05/11/2063	2,415	(1,067,786)	(502,921)	(564,865)
Insgesamt				<u>\$ (13,888,961)</u>	<u>\$ (5,127,632)</u>	<u>\$ (8,761,329)</u>
Swaps insgesamt						<u>\$ (8,887,048)</u>

* Kapitalbetrag geringer als 500.

- (a) Variabel verzinsliches Wertpapier. Der angegebene Zinssatz galt am 31. August 2021.
- (b) Zinsvariabler Kupon, angegebener Zinssatz vom 31. August 2021.
- (c) Wertpapier, bei dem bis zur Endfälligkeit nur umgekehrte Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (d) Kredit, bei dem bis zur Endfälligkeit nur Zins- und keine Tilgungszahlungen zu leisten sind.
- (e) Zum angemessenen Marktwert entsprechend den Verfahren bewertet, die von und unter der allgemeinen Aufsicht der Verwaltungsgesellschaft festgelegt werden.
- (f) Not leidendes fälliges Wertpapier.
- (g) Tagesgeld.

Währungskürzel:

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

Glossar:

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

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS

31. August 2021

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Global Value Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	\$ 42,498,690	\$ 132,259,323	\$ 905,449,207
Termineinlagen.	4,765,586	3,068,843	24,046,881
Dividenden- und Zinsforderungen	112,108	108,671	1,245,448
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	396,044	1,184,148	-0-
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	52,080	51,157	6,845,520
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	775	-0-	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	99,829	254,062	2,324,442
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	96,664	-0-	-0-
Zinsforderungen aus Swaps	3,149	-0-	-0-
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	345,772	104,729	1,447,388
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	46,687	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0-	169	1,757
Sonstige Forderungen	43,271	-0-	-0-
	<u>48,460,655</u>	<u>137,031,102</u>	<u>941,360,643</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	861,273	124,636	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	23,080	-0-	-0-
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	202,389	-0-	3,375,183
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	-0-	-0-	-0-
Zu zahlende Dividenden	-0-	-0-	665,629
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	1,762,022	93,460	4,597,906
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	35,185	127,137	246,421
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	-0-	-0-	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	34,120	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps	1,296	-0-	-0-
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	219,940	345,586	1,139,483
	<u>3,139,305</u>	<u>690,819</u>	<u>10,024,622</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>\$ 45,321,350</u>	<u>\$ 136,340,283</u>	<u>\$ 931,336,021</u>

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Sustainable US Thematic Portfolio (USD)	Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)	Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)
\$ 722,410,779	\$ 931,501,473	\$ 362,839,543	¥ 8,368,186,944	\$ 145,851,103	\$ 509,846,051	\$ 20,315,033,138	\$ 24,848,291,831
3,171,255	53,985,969	11,500,756	122,958,214	8,589,756	11,019,950	695,087,402	705,777,989
1,363,651	482,897	910,570	10,697,997	248,096	4,938,918	308,104,793	284,500,116
8,093,213	-0-	2,846,670	-0-	-0-	5,781,130	204,170,351	203,364,395
1,057,866	12,583,570	3,908,263	1,277,463	356,130	2,731,713	197,906,904	142,908,425
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	256,526,565	135,565,344
48,941	205,943	987,570	5,376,088	651,814	4,153,264	68,762,244	12,633,167
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	410,006	40,545,626	31,564,249
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	171,249	30,747,946	18,879,690
12,908,494	-0-	5,301,029	68,373,534	-0-	-0-	5,685,347	14,328,748
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	43,765	2,904,477	5,446,899
1,408	5,265	-0-	51,888	962	-0-	-0-	-0-
-0-	-0-	-0-	1,257,734	-0-	-0-	15,445	-0-
<u>749,055,607</u>	<u>998,765,117</u>	<u>388,294,401</u>	<u>8,578,179,862</u>	<u>155,697,861</u>	<u>539,096,046</u>	<u>22,125,490,238</u>	<u>26,403,260,853</u>
4,303,383	15,842,201	10,914,231	55,045,749	-0-	2,397,698	187,913,409	534,213,413
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	122,078	268,680,071	411,932,061
-0-	2,511,239	-0-	6,626,609	404,072	1,412,094	361,584,382	213,063,582
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	275,802,304	196,999,359
9,082	-0-	549,302	6,402,296	221,669	557,554	117,531,353	82,192,285
1,332,778	1,657,160	797,146	7,913,416	1,135,092	884,754	40,435,802	65,920,452
-0-	-0-	-0-	1,740,183	-0-	908,167	32,400,391	13,631,690
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	2,178,537	7,952,197
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	710,348	274,985	6,250,666
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	144,164	43	4,775,730
<u>1,452,239</u>	<u>1,100,991</u>	<u>2,184,609</u>	<u>17,451,244</u>	<u>339,956</u>	<u>674,848</u>	<u>32,743,047</u>	<u>28,889,879</u>
<u>7,097,482</u>	<u>21,111,591</u>	<u>14,445,288</u>	<u>95,179,497</u>	<u>2,100,789</u>	<u>7,811,705</u>	<u>1,319,544,324</u>	<u>1,565,821,314</u>
<u>\$ 741,958,125</u>	<u>\$ 977,653,526</u>	<u>\$ 373,849,113</u>	<u>¥ 8,483,000,365</u>	<u>\$ 153,597,072</u>	<u>\$ 531,284,341</u>	<u>\$ 20,805,945,914</u>	<u>\$ 24,837,439,539</u>

ZUSAMMENSETZUNG DES FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)

31. August 2021

AB FCPI

	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)
VERMÖGENSWERTE			
Anlagen in Wertpapiere zum Wert	€ 2,160,807,923	\$ 853,750,966	\$ 1,434,781,966
Termineinlagen	52,026,942	2,941,271	124,911,535
Dividenden- und Zinsforderungen	35,230,376	11,967,482	6,572,644
Von der Hinterlegungsstelle/dem Broker gehaltene Barmittel	438,951	5,574,832	16,099,461
Forderungen aus verkauftem Anteilkapital	17,552,772	1,105,469	39,562,600
Für Swap-Kontrakte bezahlte Vorabgebühren	-0-	819,039	-0-
Unrealisierte Wertsteigerung aus Devisentermingeschäften	1,509,246	4,123,538	816,341
Unrealisierte Wertsteigerung aus Swaps	-0-	-0-	295,254
Zinsforderungen aus Swaps	-0-	938	102,980
Forderungen aus verkauften Anlagewertpapieren	-0-	-0-	96,793
Unrealisierte Wertsteigerung aus Finanzterminkontrakten	10,673,440	-0-	-0-
Forderungen aus der Wertpapierleihe	-0-	-0-	-0-
Sonstige Forderungen	-0-	-0-	134,378
	<u>2,278,239,650</u>	<u>880,283,535</u>	<u>1,623,373,952</u>
VERBINDLICHKEITEN			
Verbindlichkeiten für gekaufte Anlagewertpapiere	2,761,668	1,399,207	103,471,513
Unrealisierte Wertminderung aus Swaps	-0-	1,633,304	9,182,302
An die Hinterlegungsstelle/den Broker zahlbar	7,868,336	-0-	4,012,644
Für Swap-Kontrakte erhaltene Vorabgebühren	-0-	-0-	5,127,632
Zu zahlende Dividenden	7,947,044	3,143,015	4,025,255
Verbindlichkeiten für eingelöstes Anteilkapital	2,026,075	2,211,723	2,171,546
Unrealisierte Wertminderung aus Devisentermingeschäften	5,763,830	247,425	-0-
Verkaufte Optionen, zum Marktwert	15,267	-0-	-0-
Unrealisierte Wertminderung aus Finanzterminkontrakten	1,874,790	-0-	-0-
Zinsaufwand für Swaps	1	148,699	165,726
Antizipative Passiva und andere Verbindlichkeiten	4,486,285	1,381,516	1,444,421
	<u>32,743,296</u>	<u>10,164,889</u>	<u>129,601,039</u>
NETTOVERMÖGEN	<u>€ 2,245,496,354</u>	<u>\$ 870,118,646</u>	<u>\$ 1,493,772,913</u>

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

**Kombiniert
(USD)**

\$ 53,564,396,161*
1,711,696,993
660,844,545*
449,708,165
429,805,880
392,914,724
96,990,108
73,048,932
49,926,909
40,840,499
21,136,125
10,033
204,539
<u>57,491,523,613*</u>
866,714,374
691,616,912
596,122,135
477,945,092
216,839,742*
125,464,040
54,441,009
10,148,760
9,508,920
5,247,822
77,435,805
<u>3,131,484,611*</u>
<u>\$ 54,360,039,002*</u>

ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES FONDSVERMÖGENS

Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2021

AB FCPI

	Dynamic Diversified Portfolio (USD)	Global Equity Blend Portfolio (USD)	Global Value Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	\$ 287,537	\$ -0-	\$ 860
Swap-Erträge	17,023	-0-	-0-
Dividenden, netto	382,613	1,554,340	13,396,212
Erträge auf aus Wertpapierleihe, netto	-0-	4,657	28,499
	<u>687,173</u>	<u>1,558,997</u>	<u>13,425,571</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	547,670	901,324	4,702,661
Aufwendungen für Swaps	14,837	-0-	-0-
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	42,734	35,493	291,046
Transferstelle	43,420	27,871	253,263
Steuern	21,367	23,317	181,263
Vertriebsgebühr	39,270	20,716	19,769
Depotbankgebühren	147,354	24,773	78,231
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	171,181	50,217	195,832
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	33,442	44,110	103,772
Druckkosten	996	904	2,305
Sonstige Aufwendungen	39,959	15,797	56,111
	<u>1,102,230</u>	<u>1,144,522</u>	<u>5,884,253</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	<u>(312,200)</u>	<u>(37,376)</u>	<u>(13)</u>
Nettoaufwendungen	790,030	1,107,146	5,884,240
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>(102,857)</u>	<u>451,851</u>	<u>7,541,331</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	6,722,683	31,577,924	42,642,551
Kapitalertragsteuer	(15)	(233,051)	(56,819)
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	881,253	3,971,270	111,167,339
Aus Finanzterminkontrakten	98,891	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften	284,447	619,303	2,684,357
Aus Swaps	(365,827)	-0-	-0-
Aus verkauften Optionen	<u>(1,260)</u>	<u>-0-</u>	<u>-0-</u>
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	7,517,315	36,387,297	163,978,759
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(4,508,119)	(6,486,000)	406,686,066
Ausschüttungen	-0-	-0-	(5,416,913)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	42,312,154	106,438,986	366,088,109
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	<u>\$ 45,321,350</u>	<u>\$ 136,340,283</u>	<u>\$ 931,336,021</u>

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Emerging Markets Growth Portfolio (USD)	Sustainable US Thematic Portfolio (USD)	Asia Ex-Japan Equity Portfolio (USD)	Japan Strategic Value Portfolio (JPY)	China Low Volatility Equity Portfolio (USD)	Short Duration Bond Portfolio (USD)	Global High Yield Portfolio (USD)	American Income Portfolio (USD)
\$ 5,517	\$ 2,204	\$ 3,414	¥ -0-	\$ 2,796	\$ 18,069,425	\$ 1,410,050,361	\$ 1,434,458,003
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	1,035,687	253,564,220	157,684,936
14,997,861	2,807,040	12,394,512	179,541,475	3,801,543	-0-	51,696,429	27,226,092
195,374	11,453	3,013	432,648	7,671	-0-	-0-	-0-
15,198,752	2,820,697	12,400,939	179,974,123	3,812,010	19,105,112	1,715,311,010	1,619,369,031
12,567,458	5,225,243	3,809,742	67,380,187	1,927,739	3,738,074	266,155,347	264,096,308
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	922,556	37,246,590	14,446,765
751,953	222,880	106,038	2,161,597	50,875	485,745	17,764,978	23,943,522
399,884	269,683	209,398	4,966,993	122,932	318,173	9,576,169	10,756,427
373,406	253,216	108,473	2,131,960	51,061	243,156	9,000,079	11,798,711
88,258	26,706	130,289	190,485	33,836	7,221	11,552,237	7,339,385
253,824	21,030	137,825	-0-	38,581	166,805	2,228,944	1,994,783
242,242	158,919	223,888	21,727,147	114,198	202,027	946,533	906,246
122,945	103,558	75,891	4,148,333	48,449	96,553	217,350	217,349
6,940	4,475	34,770	2,821,595	-0-	-0-	317,267	368,177
248,749	56,700	47,667	10,465,952	47,774	70,184	966,799	1,075,507
15,055,659	6,342,410	4,883,981	115,994,249	2,435,445	6,250,494	355,972,293	336,943,180
(3)	(12,769)	(22,005)	(19,162,350)	(102,918)	(103,870)	-0-	(207)
15,055,656	6,329,641	4,861,976	96,831,899	2,332,527	6,146,624	355,972,293	336,942,973
143,096	(3,508,944)	7,538,963	83,142,224	1,479,483	12,958,488	1,359,338,717	1,282,426,058
139,792,494	36,998,078	66,801,556	747,091,014	23,854,581	(2,533,139)	340,497,816	478,734,090
(6,671)	-0-	(2,556,369)	-0-	-0-	(1,499)	(139,231)	-0-
(8,655,345)	140,859,345	29,765,174	1,007,844,512	(29,508,448)	(18,448,366)	799,078,483	(410,695,956)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	(482,368)	3,042,922	7,897,857
(20,471)	125,883	(162,995)	(13,822,887)	206,794	9,604,476	(56,979,319)	(75,816,647)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	834,248	(110,170,784)	(32,554,368)
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	(385,098)	(2,347,748)
131,253,103	174,474,362	101,386,329	1,824,254,863	(3,967,590)	1,931,840	2,334,283,506	1,247,643,286
(172,253,947)	508,620,513	(21,417,772)	(1,937,477,315)	13,313,463	(34,713,557)	(443,551,124)	(3,546,543,593)
(139,440)	-0-	(5,966,053)	(86,573,191)	(1,959,999)	(6,894,639)	(1,365,144,973)	(1,061,045,621)
783,098,409	294,558,651	299,846,609	8,682,796,008	146,211,198	570,960,697	20,280,358,505	28,197,385,467
-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-	-0-
<u>\$ 741,958,125</u>	<u>\$ 977,653,526</u>	<u>\$ 373,849,113</u>	<u>¥ 8,483,000,365</u>	<u>\$ 153,597,072</u>	<u>\$ 531,284,341</u>	<u>\$ 20,805,945,914</u>	<u>\$ 24,837,439,539</u>

**ERTRAGS- UND AUFWANDSRECHNUNG UND VERÄNDERUNG DES
FONDSVERMÖGENS (Fortsetzung)**
Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2021

AB FCPI

	European Income Portfolio (EUR)	Emerging Markets Debt Portfolio (USD)	Mortgage Income Portfolio (USD)
ANLAGEERTRÄGE			
Zinsen	€ 103,429,783	\$ 54,457,986	\$ 89,019,533
Swap-Erträge	235,427	30,950	2,282,079
Dividenden, netto	-0-	-0-	-0-
Erträge auf aus Wertpapierleihe, netto	-0-	-0-	-0-
	<u>103,665,210</u>	<u>54,488,936</u>	<u>91,301,612</u>
AUFWENDUNGEN			
Verwaltungsgebühr	21,744,777	7,401,921	9,719,109
Aufwendungen für Swaps	459,670	243,085	585,322
Gebühr der Verwaltungsgesellschaft	2,046,659	347,301	472,396
Transferstelle	1,033,049	523,920	649,475
Steuern	1,010,521	341,374	477,403
Vertriebsgebühr	113,073	160,351	6,600
Depotbankgebühren	441,905	173,056	133,311
Gebühr für professionelle Dienstleistungen	325,295	336,280	200,280
Bilanzierungs- und Administrationsgebühr	171,113	128,663	179,681
Druckkosten	30,242	575	8,959
Sonstige Aufwendungen	281,776	128,779	40,011
	<u>27,658,080</u>	<u>9,785,305</u>	<u>12,472,547</u>
Rückerstattete oder erlassene Aufwendungen	-0-	-0-	(1,655)
Nettoaufwendungen	<u>27,658,080</u>	<u>9,785,305</u>	<u>12,470,892</u>
Netto-Anlageertrag/(-verlust)	<u>76,007,130</u>	<u>44,703,631</u>	<u>78,830,720</u>
REALISIERTE GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen, Devisentermingeschäften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen	(26,107,446)	25,792,346	(10,390,325)
Kapitalertragsteuer	-0-	-0-	-0-
ÄNDERUNG DER UNREALISIERTEN GEWINNE UND (VERLUSTE)			
Aus Anlagen	81,219,855	(9,008,371)	32,691,035
Aus Finanzterminkontrakten	1,446,810	-0-	-0-
Aus Devisentermingeschäften	6,108,525	(1,139,846)	(273,311)
Aus Swaps	-0-	(1,739,310)	3,776,920
Aus verkauften Optionen	(248,968)	-0-	-0-
Ergebnis der Geschäftstätigkeit	<u>138,425,906</u>	<u>58,608,450</u>	<u>104,635,039</u>
EIGENKAPITALTRANSAKTIONEN			
Steigerung/(Minderung)	(234,246,757)	(95,483,229)	117,681,789
Ausschüttungen	(85,112,512)	(34,719,387)	(51,133,534)
NETTOVERMÖGEN			
Zu Beginn des Geschäftsjahres	2,426,429,717	941,712,812	1,322,589,619
Anpassung aus Währungsumrechnung	-0-	-0-	-0-
Am Ende des Geschäftsjahres	<u>€ 2,245,496,354</u>	<u>\$ 870,118,646</u>	<u>\$ 1,493,772,913</u>

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

Siehe Anmerkungen zum Jahresabschluss.

Kombiniert (USD)
\$ 3,130,493,065
415,007,304
110,927,815*
254,691
3,656,682,875*
607,479,437
54,064,145
46,982,805
24,432,925
24,101,983
19,561,554
5,949,275
4,364,484
1,633,208
807,854
3,257,044
792,634,714
(771,226)
791,863,488
2,864,819,387*
1,155,959,057
(2,993,695)
744,520,083*
12,330,191
(113,434,578)
(140,165,144)
(3,031,672)
4,518,003,629*
(3,596,453,179)*
(2,616,387,955)*
56,084,905,580
(30,029,073)*
\$ 54,360,039,002*

KLASSE	Dynamic Diversified Portfolio	Global Equity Blend Portfolio	Global Value Portfolio
A.....	190,464	563,814	3,337,717
A EUR.....	8,563	15,795	232,606
A EUR H.....	37,177	217,512	-0-
A SGD.....	-0-	88,867	3,089,306
A SGD H.....	-0-	-0-	406,846
AD.....	-0-	-0-	1,866,014
AD AUD H.....	-0-	-0-	2,919,583
AD CAD H.....	-0-	-0-	529,956
AD EUR H.....	-0-	-0-	63,997
AD GBP H.....	-0-	-0-	356,538
AD HKD.....	-0-	-0-	1,079,131
AD SGD H.....	-0-	-0-	1,080
AD ZAR H.....	-0-	-0-	901,672
AX.....	569,832	-0-	-0-
AX EUR.....	1,701	-0-	-0-
AX SGD.....	55,567	-0-	-0-
B.....	-0-	31,376	8,592
B SGD.....	-0-	6,517	-0-
BD.....	-0-	-0-	3,823
BX.....	51,126	-0-	-0-
BX SGD.....	66	-0-	-0-
C.....	100,389	169,066	193,729
C EUR.....	2,897	208	8,225
C EUR H.....	501	-0-	-0-
CX.....	62,387	-0-	-0-
I.....	486,162	66,941	5,471,375
I EUR.....	10,546	5,841	1,567,699
I EUR H.....	107,902	-0-	-0-
I SGD.....	-0-	-0-	169,901
IX.....	1,609	-0-	-0-
S.....	-0-	-0-	3,338,767
S GBP.....	-0-	-0-	416
S GBP H.....	-0-	-0-	637,989
S HKD.....	-0-	644,205	-0-
S1.....	-0-	286,930	9,865,309
S1 EUR.....	-0-	272	360
S1 EUR H.....	476	-0-	-0-
S1 GBP.....	-0-	277	2,660
S1 SGD.....	-0-	1,735,970	-0-
SD.....	-0-	-0-	810,555

	Emerging Markets Growth Portfolio	Sustainable US Thematic Portfolio	Asia Ex-Japan Equity Portfolio
KLASSE			
A.....	10,310,249	5,663,644	856,361
A AUD H.....	219,406	45,264	241,826
A CAD H.....	-0-	125,892	-0-
A EUR.....	76,495	477,517	71,400
A EUR H.....	-0-	199,146	-0-
A GBP H.....	-0-	29,488	-0-
A HKD.....	18,773	202,491	67,047
A PLN H.....	15,583	-0-	-0-
A SGD.....	1,467	-0-	-0-
A SGD H.....	2,373	72,750	7,371
AD.....	3,971	-0-	2,010,726
AD AUD H.....	-0-	-0-	2,704,269
AD CAD H.....	-0-	-0-	626,512
AD EUR.....	-0-	-0-	41,183
AD EUR H.....	-0-	-0-	30,754
AD GBP H.....	-0-	-0-	277,948
AD HKD.....	-0-	-0-	874,418
AD NZD H.....	-0-	-0-	521,533
AD RMB H.....	-0-	-0-	990
AD SGD H.....	-0-	-0-	1,166
AD ZAR H.....	-0-	-0-	2,328,310
AN.....	-0-	667	-0-
AY JPY.....	-0-	-0-	133,205,592
B.....	18,772	55,077	-0-
BD.....	-0-	-0-	12,172
BD AUD H.....	-0-	-0-	16,875
BD CAD H.....	-0-	-0-	5,448
BD HKD.....	-0-	-0-	11,249
BD NZD H.....	-0-	-0-	384
BD ZAR H.....	-0-	-0-	1,999
BY JPY.....	-0-	-0-	1,014,745,001
C.....	234,702	422,537	2,957
C AUD H.....	1,495	-0-	761
C EUR.....	3,144	39,995	119,944
C EUR H.....	-0-	535	-0-
C SGD.....	-0-	7,042	-0-
E.....	-0-	29,927	-0-
ED.....	358,648	-0-	336,205
I.....	1,042,235	6,846,199	764,379
I AUD H.....	3,609	-0-	761
I EUR.....	148,412	985,762	5,830
I EUR H.....	-0-	39,331	-0-
I GBP.....	-0-	2,730	382
ID.....	-0-	-0-	1,055
ID AUD H.....	-0-	-0-	1,478
IN.....	-0-	667	-0-
IN EUR.....	-0-	110	-0-
N.....	13,680	-0-	-0-
S.....	255	216,594	530,928
S HKD.....	-0-	-0-	616,433
S1.....	813,549	2,095,678	2,692,011
S1 EUR.....	128	1,587,303	311
S1 GBP.....	131	-0-	-0-
S1 JPY H.....	-0-	7,500	-0-
SD.....	-0-	-0-	340,361

UMLAUFENDE ANTEILE (Fortsetzung)

31. August 2021

AB FCPI

KLASSE	Japan Strategic Value Portfolio	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio
A.....	61,199	632,257	1,582,881
A AUD H.....	667	-0-	-0-
A CZK H.....	424	-0-	-0-
A EUR.....	18,904	23,852	16,593
A EUR H.....	22,477	-0-	-0-
A HKD.....	-0-	28,318	-0-
A NZD H.....	833	-0-	-0-
A PLN.....	90	-0-	-0-
A PLN H.....	-0-	12,362	-0-
A SGD.....	727	-0-	-0-
A SGD H.....	578	-0-	-0-
A USD.....	40,832	-0-	-0-
A USD H.....	173,463	-0-	-0-
A2.....	-0-	-0-	8,741,553
A2 EUR.....	-0-	-0-	104,029
A2 EUR H.....	-0-	-0-	4,324
A2 HKD.....	-0-	-0-	83,617
A2 SGD H.....	-0-	-0-	833
AA.....	-0-	-0-	301,931
AA AUD H.....	-0-	-0-	1,415,656
AA CAD H.....	-0-	-0-	665,936
AA GBP H.....	-0-	-0-	542,063
AA HKD.....	-0-	-0-	882,503
AA NZD H.....	-0-	-0-	1,097
AA SGD H.....	-0-	-0-	130,770
AD.....	12,388	395,062	-0-
AD AUD H.....	358,665	1,209,222	-0-
AD CAD H.....	-0-	67,211	-0-
AD EUR H.....	-0-	27,999	-0-
AD GBP H.....	-0-	68,324	-0-
AD HKD.....	-0-	146,913	-0-
AD NZD H.....	43,267	111,746	-0-
AD RMB H.....	-0-	921	-0-
AD SGD H.....	-0-	1,707	-0-
AD USD H.....	74,250	-0-	-0-
AD ZAR H.....	49,334	2,230,640	-0-
AJ.....	-0-	-0-	4,478,696
AR EUR H.....	-0-	-0-	679
AT.....	-0-	-0-	8,102,935
AT AUD H.....	-0-	-0-	418,941
AT CAD H.....	-0-	-0-	64,771
AT EUR.....	-0-	-0-	50,215
AT EUR H.....	-0-	-0-	10,702
AT GBP H.....	-0-	-0-	70,393
AT HKD.....	-0-	-0-	178,026
AT NZD H.....	-0-	-0-	76,802
AT SGD H.....	-0-	-0-	25,779
AX.....	-0-	-0-	16,779
B.....	-0-	16,206	10,120
B EUR.....	-0-	326	-0-
B2 EUR.....	-0-	-0-	433
BD AUD H.....	1,795	-0-	-0-
BD NZD H.....	-0-	1,248	-0-
BD ZAR H.....	-0-	1,226	-0-
BT.....	-0-	-0-	8,120
C.....	232	8,547	368,350
C EUR.....	147	2,772	-0-
C EUR H.....	521	-0-	-0-

	Japan Strategic Value Portfolio	China Low Volatility Equity Portfolio	Short Duration Bond Portfolio
KLASSE			
C USD	1,291	-0-	-0-
C2	-0-	-0-	534,004
C2 EUR H	-0-	-0-	457
I	359	4,314	1,781,934
I EUR	28,783	402	1,258
I EUR H	367	-0-	-0-
I SGD	100	-0-	-0-
I USD	33,928	-0-	-0-
I USD H	15,882	-0-	-0-
I2	-0-	-0-	4,031,093
I2 AUD H	-0-	-0-	1,468
I2 EUR	-0-	-0-	717
I2 EUR H	-0-	-0-	1,000,864
IT	-0-	-0-	357,793
IT AUD H	-0-	-0-	924
N2	-0-	-0-	264,356
NT	-0-	-0-	197,206
S	-0-	128,451	405,989
S EUR H	421	-0-	1,041
S SGD H	-0-	-0-	833
S1	-0-	535,729	-0-
S1 2	-0-	-0-	2,850,322
S1 2 EUR	-0-	-0-	567
S1 EUR	74	98	-0-
S1 EUR H	-0-	-0-	1,041
S1 USD	229,480	-0-	-0-
S1 USD H	482	-0-	-0-
SA	-0-	-0-	176,783
SD	109,485	-0-	-0-
	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
KLASSE			
A	144,057,694	189,585,282	3,164,481
A EUR	1,765,354	1,011,114	-0-
A USD	-0-	-0-	410,502
A2	52,335,343	68,793,522	3,262,307
A2 CHF H	11,175	330,140	9,145
A2 DUR PH	-0-	4,893	-0-
A2 EUR	725,000	1,367,630	-0-
A2 EUR H	3,976,862	2,457,178	-0-
A2 HKD	686,256	686,002	-0-
A2 PLN H	55,184	1,136,232	3,024
A2 SGD	14,271	26,097	-0-
A2 SGD H	738,378	840,407	933
A2 USD	-0-	-0-	448,170
A2 USD H	-0-	-0-	596,419
AA	290,667,536	110,090,997	3,329,581
AA AUD H	165,129,176	37,531,861	13,333,549
AA CAD H	1,160,585	7,259,146	-0-
AA DUR PH	-0-	1,608,659	-0-
AA EUR H	2,140,452	1,221,326	-0-
AA GBP H	5,457,375	9,221,785	-0-
AA HKD	14,428,642	34,490,843	-0-
AA HKD H	-0-	-0-	8,139,192
AA NZD H	2,389,986	4,115,498	-0-

KLASSE	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
AA RMB H	4,706,897	6,451,926	516,513
AA SGD H	1,180,270	2,048,769	272,965
AA USD H	-0-	-0-	75,794,993
AA ZAR H	276,301,321	21,941,607	-0-
AK	17,094	44,109	149,023
AK EUR	126,685	58,992	-0-
AK EUR H	3,843	55,676	-0-
AR	-0-	-0-	1,677,232
AR EUR	-0-	7,987	-0-
AR EUR H	60,613	18,169	-0-
AT	1,575,478,445	875,160,129	16,442,462
AT AUD H	93,086,638	92,844,242	5,702,123
AT CAD H	9,703,976	25,319,819	-0-
AT DUR PH	-0-	63,585	-0-
AT EUR	9,570,481	6,480,407	-0-
AT EUR H	5,931,002	7,092,985	-0-
AT GBP H	3,928,896	16,364,296	-0-
AT HKD	127,211,211	238,190,586	-0-
AT NZD H	12,883,174	12,152,680	-0-
AT RMB H	3,377,129	4,912,124	-0-
AT SGD	4,026,777	2,029,842	-0-
AT SGD H	22,241,429	33,171,753	878,319
AT USD	-0-	-0-	759,065
AT USD H	-0-	-0-	21,557,816
B	829,167	807,743	-0-
B USD	-0-	-0-	146,702
B2	10,857	69,572	680
B2 HKD	-0-	7,736	-0-
B2 USD	-0-	-0-	1,300
BA	24,205	526,675	13,012
BA AUD H	15,422	312,610	428,760
BA USD H	-0-	-0-	207,880
BA ZAR H	33,847	49,069	-0-
BT	565,662	2,941,306	17,884
BT AUD H	99,609	899,235	41,059
BT CAD H	5,049	186,706	-0-
BT EUR	-0-	1,459	-0-
BT EUR H	1,088	47,788	-0-
BT GBP H	27,075	161,462	-0-
BT HKD	20,162	1,537,503	-0-
BT NZD H	206	255,089	-0-
BT USD	-0-	-0-	1,803
BT USD H	-0-	-0-	133,607
C	21,198,448	27,186,345	1,896,775
C EUR	10,919	6,923	-0-
C USD	-0-	-0-	162,147
C2	2,026,123	7,200,179	92,056
C2 DUR PH	-0-	8,251	-0-
C2 EUR	6,035	74,303	-0-
C2 EUR H	10,639	10,125	-0-
C2 USD	-0-	-0-	11,461
C2 USD H	-0-	-0-	166,499
CK	1,029	-0-	7,596
CK EUR H	700	-0-	-0-
CT	20,226	155,844	-0-
CT USD H	-0-	-0-	39,912
EA	184,009,380	33,388,622	-0-
EA AUD H	10,572,270	4,028,282	-0-

KLASSE	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
EA ZAR H	24,516,763	5,209,009	-0-
I	28,587,360	49,991,698	1,723,898
I EUR	125,188	98,012	-0-
I USD	-0-	-0-	514,189
I2	11,890,318	59,869,277	11,215,453
I2 AUD H	4,448	3,339,487	4,351
I2 CHF H	51,068	433,671	633
I2 DUR PH	-0-	1,900	-0-
I2 EUR	34,163	2,912,544	-0-
I2 EUR H	1,329,432	2,538,806	-0-
I2 HKD	-0-	83,309	-0-
I2 SGD	31,721	498	-0-
I2 SGD H	28,547	104,059	-0-
I2 USD	-0-	-0-	56,823
I2 USD H	-0-	-0-	390,159
IA	-0-	118,873	84,439
IA AUD H	1,044,126	3,691,844	-0-
IA HKD H	-0-	-0-	11,613
IA SGD H	-0-	-0-	1,351
IA USD H	-0-	-0-	19,036
IQD	31,900	-0-	-0-
IQD EUR	2,976	-0-	-0-
IT	4,696,960	28,852,200	102,617
IT AUD H	775,565	577,938	-0-
IT CAD H	90,958	548,271	-0-
IT EUR H	23,691	482,367	-0-
IT GBP H	190,064	425,653	-0-
IT HKD	27,146	115,910	-0-
IT JPY	-0-	284,556	-0-
IT JPY H	-0-	427,665	-0-
IT NZD H	5,649	88,959	-0-
IT RMB H	10,684	343,271	-0-
IT SGD	-0-	31,898	-0-
IT SGD H	-0-	2,142,521	1,288
IT USD H	-0-	-0-	578,239
J	4,812,693	72,379,205	-0-
L2	-0-	3,333	-0-
L2 AUD H	-0-	5,000	-0-
L2 SGD H	-0-	4,667	-0-
LT	-0-	3,672	-0-
LT AUD H	-0-	5,444	-0-
LT SGD H	-0-	5,080	-0-
N2	549,842	4,973,740	-0-
NT	1,350,070	3,639,468	-0-
NT USD H	-0-	-0-	65,551
S	-0-	1,463,151	-0-
S1	20,345,448	59,142,319	315,742
S1 EUR	320	19,656	-0-
S1 USD	-0-	-0-	349
S1 USD H	-0-	-0-	11,092,627
S1D	47,987,274	29,579,010	1,449,025
S1D2	-0-	407,006	-0-
SA	628,805	3,387,532	-0-
SA USD H	-0-	-0-	683,258
SHK	263,148	2,225,914	159,000
SK	15,942,004	-0-	-0-
W	103,851	544,203	-0-
W EUR	664	-0-	-0-

	Global High Yield Portfolio	American Income Portfolio	European Income Portfolio
KLASSE			
W2	222,672	4,505,075	1,023,501
W2 CHF H	7,008	328,803	182,878
W2 EUR H	75,238	164,771	-0-
W2 USD H	-0-	-0-	4,667
WA	-0-	-0-	372,381
WA HKD H	-0-	-0-	893
WA USD H	-0-	-0-	175,392
WT	495,916	5,390,888	125,036
WT AUD H	160,931	2,028,890	-0-
WT CAD H	37,557	-0-	-0-
WT EUR H	221,719	209,712	-0-
WT GBP H	16,618	27,800	-0-
WT HKD	-0-	353,841	-0-
WT RMB H	384,064	-0-	-0-
WT SGD H	-0-	416,427	1,023
WT USD H	-0-	-0-	733
		Emerging Markets Debt Portfolio	Mortgage Income Portfolio
KLASSE			
A		1,075,121	9,470,713
A EUR		542	-0-
A2		513,117	6,984,548
A2 CHF H		600	-0-
A2 EUR		207,955	2,192
A2 EUR H		52,990	-0-
A2 HKD		11,553	1,275
A2 PLN		274	-0-
A2 PLN H		281,153	-0-
A2 SGD		-0-	565
A2 SGD H		233,894	-0-
A2X		-0-	327,968
A2X EUR		-0-	66,668
AA		5,010,171	10,151,328
AA AUD H		3,697,587	4,764,846
AA CAD H		6,304	-0-
AA EUR H		1,155	-0-
AA GBP H		15,989	-0-
AA HKD		187,105	6,484,550
AA NZD H		32,695	-0-
AA RMB H		1,118	387,125
AA SGD H		1,333	294,755
AA ZAR H		8,632,546	2,047,956
AI		704	-0-
AI AUD H		823	-0-
AR EUR		1,250	-0-
AR EUR H		-0-	37,991
AT		9,611,016	3,260,126
AT AUD H		5,749,889	685,471
AT CAD H		156,177	-0-
AT EUR		67,137	22,656
AT EUR H		291,068	-0-
AT GBP H		92,745	15,365
AT HKD		788,605	83,084
AT NZD H		517,394	-0-
AT RMB H		12,807	-0-
AT SGD		-0-	793

KLASSE	Emerging Markets Debt Portfolio	Mortgage Income Portfolio
AT SGD H	303,723	60,992
AX	-0-	466,230
AX EUR	-0-	3,191
B2 EUR	1,106	-0-
B2 HKD	1,615	-0-
B2X	-0-	11,666
BA	3,232	-0-
BA AUD H	3,171	-0-
BA ZAR H	4,327	-0-
BT	37,230	-0-
BT AUD H	1,520	-0-
BT EUR H	695	-0-
BT HKD	6,482	-0-
BX	-0-	58,274
BX EUR	-0-	3,298
C	270,477	1,920,870
C EUR	2,638	-0-
C2	114,954	1,666,745
C2 EUR	843	507
C2 EUR H	691	-0-
C2X	-0-	3,920
CT	1,021	-0-
CX	-0-	15,335
EA	1,233,467	-0-
EA AUD H	246,089	-0-
EA ZAR H	545,375	-0-
EI	138,793	-0-
EI AUD H	5,918	-0-
I	683,656	3,961,149
I EUR	-0-	4,881
I2	135,721	9,501,730
I2 CHF H	600	-0-
I2 EUR	1,464	28,269
I2 EUR H	3,574,309	398,883
I2X	-0-	1,092
IT AUD H	1,767	-0-
IT EUR H	1,333,333	3,657
IT SGD H	1,321	-0-
IX	-0-	89,734
N2	16,739	348,780
NT	51,178	611,070
S	203,102	765,822
S EUR H	521	-0-
S GBP H	431	-0-
S1	-0-	21,201,242
S1 2	3,810,632	-0-
S1 2 EUR	266	-0-
S1 EUR	-0-	541
S1 EUR H	521	23,982
S1 GBP H	431	-0-
S1 JPY	-0-	1,255
S1QD EUR H	440,173	-0-
S1X	-0-	2,230
SA	807,245	3,315,810

	Dynamic Diversified Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 45,321,350	\$ 42,312,154	\$ 49,287,869
Klasse			
A	\$ 24.23	\$ 20.37	\$ 19.46
A EUR (1)	€ 20.52	€ 17.07	€ 17.71
A EUR H	€ 21.21	€ 18.04	€ 17.71
AX	\$ 29.21	\$ 24.54	\$ 23.43
AX EUR (1)	€ 24.73	€ 20.57	€ 21.32
AX SGD (1)	SGD39.30	N/A	N/A
B (2)	N/A	\$ 18.54	\$ 17.89
BX	\$ 24.71	\$ 20.98	\$ 20.22
BX SGD (1)	SGD33.27	N/A	N/A
C	\$ 23.61	\$ 19.91	\$ 19.07
C EUR (1)	€ 20.00	€ 16.69	€ 17.35
C EUR H	€ 20.68	€ 17.65	€ 17.37
CX	\$ 27.91	\$ 23.53	\$ 22.52
I	\$ 25.86	\$ 21.59	\$ 20.47
I EUR (1)	€ 21.90	€ 18.10	€ 18.62
I EUR H	€ 22.63	€ 19.12	€ 18.63
IX	\$ 32.57	\$ 27.18	\$ 25.76
S1 EUR H	€ 23.91	€ 20.11	€ 19.52

	Global Equity Blend Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 136,340,283	\$ 106,438,986	\$ 105,961,928
Klasse			
A	\$ 29.48	\$ 21.89	\$ 18.83
A EUR (1)	€ 24.97	\$ 18.35	€ 17.13
A EUR H	€ 26.48	€ 19.91	€ 17.69
A SGD (1)	SGD39.67	N/A	N/A
B	\$ 24.63	\$ 18.47	\$ 16.04
B SGD (1)	SGD33.14	N/A	N/A
C	\$ 27.48	\$ 20.49	\$ 17.71
C EUR (1)	€ 23.28	\$ 17.17	€ 16.11
I	\$ 34.15	\$ 25.15	\$ 21.46
I EUR (1)	€ 28.92	\$ 21.08	€ 19.53
S (3)	N/A	\$ 30.16	\$ 25.43
S HKD (1)	HKD321.85	N/A	N/A
S1	\$ 37.09	\$ 27.22	\$ 23.11
S1 EUR (1)	€ 31.41	\$ 22.81	€ 21.03
S1 GBP (1)	£ 26.98	N/A	N/A
S1 SGD (1)	SGD49.91	N/A	N/A

	Global Value Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	\$ 931,336,021	\$ 366,088,109	\$ 322,476,894
Klasse			
A	\$ 22.10	\$ 16.51	\$ 15.98
A EUR (1)	€ 18.72	€ 13.84	€ 14.54
A SGD (1)	SGD29.74	N/A	N/A
A SGD H	SGD22.33	SGD16.74	SGD16.45
AD	\$ 16.83	\$ 13.04	\$ 13.21
AD AUD H	AUD15.52	AUD12.18	AUD12.93
AD CAD H	CAD15.90	CAD12.43	CAD12.91
AD EUR H	€ 16.58	€ 12.93	€ 13.23
AD GBP H	£ 15.93	£ 12.48	£ 12.96
AD HKD (1)	HKD130.89	N/A	N/A
AD SGD H	SGD16.49	SGD12.82	SGD13.14
AD ZAR H	R105.47	R81.72	R85.67
B	\$ 18.07	\$ 13.63	\$ 13.32
BD	\$ 17.13	\$ 13.30	\$ 13.45
BD AUD H (4)	N/A	AUD12.25	AUD12.97
BD EUR H (5)	N/A	€ 12.96	€ 13.26
BD ZAR H (6)	N/A	R82.18	R86.08
C	\$ 20.38	\$ 15.29	\$ 14.87
C EUR (1)	€ 17.26	€ 12.82	€ 13.53
I	\$ 25.82	\$ 19.13	\$ 18.37
I EUR (1)	€ 21.86	€ 16.03	€ 16.71
I SGD (1)	SGD34.74	N/A	N/A
S	\$ 30.21	\$ 22.18	\$ 21.09
S GBP (1)	£ 21.99	N/A	N/A
S GBP H	£ 23.67	£ 17.55	£ 17.27
S1	\$ 27.16	\$ 20.08	\$ 19.23
S1 EUR (1)	€ 23.00	€ 16.83	€ 17.50
S1 GBP (1)	£ 19.76	N/A	N/A
SD	\$ 113.75	\$ 87.93	\$ 89.25

	Emerging Markets Growth Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	\$ 741,958,125	\$ 783,098,409	\$ 822,876,301
Klasse			
A	\$ 55.85	\$ 47.83	\$ 40.31
A AUD H	AUD24.54	AUD21.28	AUD18.76
A EUR (1)	€ 47.29	€ 40.09	€ 36.68
A HKD (1)	HKD434.41	N/A	N/A
A PLN H	PLN124.64	PLN108.36	PLN93.51
A SGD (1)	SGD75.15	N/A	N/A
A SGD H	SGD19.07	SGD16.40	SGD14.01
AD	\$ 21.42	\$ 18.84	\$ 16.43
B	\$ 42.14	\$ 36.45	\$ 31.03
C	\$ 45.94	\$ 39.52	\$ 33.46
C AUD H	AUD23.10	AUD20.13	AUD17.83
C EUR (1)	€ 38.91	€ 33.12	€ 30.44
ED	\$ 15.41	\$ 13.59	\$ 11.86
I	\$ 67.94	\$ 57.72	\$ 48.26

	Emerging Markets Growth Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
I AUD H	<u>AUD26.53</u>	<u>AUD22.82</u>	<u>AUD19.96</u>
I CHF H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>CHF12.26</u>
I EUR (1)	<u>€ 57.54</u>	<u>€ 48.38</u>	<u>€ 43.91</u>
N	<u>\$ 27.50</u>	<u>\$ 23.65</u>	<u>\$ 20.02</u>
S	<u>\$ 81.32</u>	<u>\$ 68.35</u>	<u>\$ 56.50</u>
S1	<u>\$ 70.69</u>	<u>\$ 59.95</u>	<u>\$ 50.02</u>
S1 EUR (1)	<u>€ 59.87</u>	<u>€ 50.25</u>	<u>€ 45.51</u>
S1 GBP (1)	<u>£ 51.44</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
	Sustainable US Thematic Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	<u>\$ 977,653,526</u>	<u>\$ 294,558,651</u>	<u>\$ 132,983,933</u>
Klasse			
A	<u>\$ 44.79</u>	<u>\$ 33.33</u>	<u>\$ 25.61</u>
A AUD H	<u>AUD77.84</u>	<u>AUD58.29</u>	<u>AUD46.77</u>
A CAD H	<u>CAD71.82</u>	<u>CAD53.68</u>	<u>CAD41.99</u>
A EUR (1)	<u>€ 37.94</u>	<u>€ 27.94</u>	<u>€ 23.30</u>
A EUR H	<u>€ 69.98</u>	<u>€ 52.68</u>	<u>€ 41.47</u>
A GBP H	<u>£ 58.61</u>	<u>£ 43.78</u>	<u>£ 34.61</u>
A HKD (1)	<u>HKD348.44</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
A SGD H	<u>SGD58.00</u>	<u>SGD43.26</u>	<u>SGD33.63</u>
AN	<u>\$ 86.34</u>	<u>\$ 64.25</u>	<u>\$ 49.37</u>
B	<u>\$ 36.69</u>	<u>\$ 27.57</u>	<u>\$ 21.40</u>
B CAD H	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>	<u>CAD38.86</u>
C	<u>\$ 42.48</u>	<u>\$ 31.76</u>	<u>\$ 24.51</u>
C EUR (1)	<u>€ 35.98</u>	<u>€ 26.62</u>	<u>€ 22.30</u>
C EUR H	<u>€ 67.10</u>	<u>€ 50.73</u>	<u>€ 40.12</u>
C SGD (1)	<u>SGD57.17</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
E (7)	<u>\$ 16.74</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
I	<u>\$ 52.90</u>	<u>\$ 39.05</u>	<u>\$ 29.77</u>
I EUR (1)	<u>€ 44.80</u>	<u>€ 32.73</u>	<u>€ 27.09</u>
I EUR H	<u>€ 76.00</u>	<u>€ 56.75</u>	<u>€ 44.34</u>
I GBP	<u>£ 24.84</u>	<u>£ 18.85</u>	<u>N/A</u>
IN	<u>\$ 94.40</u>	<u>\$ 69.69</u>	<u>\$ 53.13</u>
IN EUR (1)	<u>€ 79.95</u>	<u>€ 58.41</u>	<u>N/A</u>
S	<u>\$ 72.04</u>	<u>\$ 52.74</u>	<u>\$ 39.86</u>
S1	<u>\$ 55.82</u>	<u>\$ 41.13</u>	<u>\$ 31.29</u>
S1 EUR (1)	<u>€ 47.27</u>	<u>€ 34.47</u>	<u>€ 28.47</u>
S1 JPY H	<u>¥ 520.00</u>	<u>¥ 385.00</u>	<u>¥ 297.00</u>

	Asia Ex-Japan Equity Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 373,849,113	\$ 299,846,609	\$ 300,017,545
Klasse			
A	\$ 27.61	\$ 20.88	\$ 19.35
A AUD H	AUD27.70	AUD21.25	AUD20.49
A EUR (1)	€ 23.38	€ 17.50	€ 17.61
A HKD (1)	HKD214.74	N/A	N/A
A SGD H	SGD19.86	SGD15.10	SGD14.19
AD	\$ 17.93	\$ 14.00	\$ 13.50
AD AUD H	AUD15.54	AUD12.32	AUD12.28
AD CAD H	CAD13.21	CAD10.41	CAD10.21
AD EUR (1)	€ 15.18	€ 11.73	€ 12.28
AD EUR H	€ 16.40	€ 12.92	€ 12.57
AD GBP H	£ 16.34	£ 12.90	£ 12.66
AD HKD (1)	HKD139.44	N/A	N/A
AD NZD H	NZD16.92	NZD13.36	NZD13.21
AD RMB H	CNH111.59	CNH87.37	CNH84.44
AD SGD H	SGD17.08	SGD13.41	SGD13.04
AD ZAR H	R119.83	R93.89	R91.84
AY JPY	¥ 2.19	¥ 1.59	¥ 1.48
B	N/A	N/A	\$ 17.57
BD	\$ 17.83	\$ 13.96	\$ 13.46
BD AUD H	AUD15.56	AUD12.36	AUD12.33
BD CAD H	CAD13.80	CAD10.89	CAD10.69
BD GBP H (8)	N/A	£ 12.94	£ 12.67
BD HKD (1)	HKD138.72	N/A	N/A
BD NZD H	NZD16.82	NZD13.30	NZD13.17
BD ZAR H	R107.61	R84.35	R82.52
BY JPY	¥ 2.09	¥ 1.53	¥ 1.43
C	\$ 26.19	\$ 19.90	\$ 18.51
C AUD H	AUD26.85	AUD20.68	AUD20.03
C EUR (1)	€ 22.17	€ 16.68	€ 16.84
ED	\$ 15.36	\$ 11.99	\$ 11.53
I	\$ 30.34	\$ 22.76	\$ 20.93
I AUD H	AUD30.88	AUD23.50	AUD22.47
I EUR (1)	€ 25.70	€ 19.08	€ 19.04
I GBP	£ 24.79	£ 19.12	£ 19.31
ID	\$ 17.97	\$ 14.02	\$ 13.51
ID AUD H	AUD15.83	AUD12.54	AUD12.50
S	\$ 34.48	\$ 25.59	\$ 23.27
S HKD (1)	HKD268.21	N/A	N/A
S1	\$ 30.96	\$ 23.18	\$ 21.27
S1 EUR (1)	€ 26.22	€ 19.43	€ 19.35
SD	\$ 123.26	\$ 96.21	\$ 92.96

	Japan Strategic Value Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	<u>¥ 8,483,000,365</u>	<u>¥ 8,665,430,416</u>	<u>¥ 13,432,567,077</u>
Klasse			
2 (9)	N/A	¥ 10,390.00	¥ 10,202.00
A	<u>¥ 11,676.00</u>	<u>¥ 9,542.00</u>	<u>¥ 9,439.00</u>
A AUD H	<u>AUD22.71</u>	<u>AUD18.72</u>	<u>AUD18.91</u>
A CZK H	<u>CZK952.60</u>	<u>CZK784.96</u>	<u>CZK783.08</u>
A EUR (1)	<u>€ 89.97</u>	<u>€ 75.53</u>	<u>€ 80.84</u>
A EUR H	<u>€ 27.12</u>	<u>€ 22.39</u>	<u>€ 22.47</u>
A NZD H	<u>NZD24.85</u>	<u>NZD20.39</u>	<u>NZD20.37</u>
A PLN (1)	<u>PLN406.65</u>	N/A	N/A
A SGD (1)	<u>SGD142.75</u>	N/A	N/A
A SGD H	<u>SGD16.72</u>	<u>SGD13.67</u>	<u>SGD13.56</u>
A USD (1)	<u>\$ 106.17</u>	<u>\$ 90.05</u>	<u>\$ 88.85</u>
A USD H	<u>\$ 33.08</u>	<u>\$ 27.00</u>	<u>\$ 26.55</u>
AD	<u>¥ 11,823.00</u>	<u>¥ 9,930.00</u>	<u>¥ 10,119.00</u>
AD AUD H	<u>AUD15.58</u>	<u>AUD13.24</u>	<u>AUD13.97</u>
AD NZD H	<u>NZD16.06</u>	<u>NZD13.60</u>	<u>NZD14.22</u>
AD USD H	<u>\$ 15.48</u>	<u>\$ 13.04</u>	<u>\$ 13.46</u>
AD ZAR H	<u>R108.96</u>	<u>R91.42</u>	<u>R95.90</u>
B (10)	N/A	¥ 8,294.00	¥ 8,287.00
B EUR (11)	N/A	€ 65.65	€ 70.97
BD (12)	N/A	¥ 9,861.00	¥ 10,051.00
BD AUD H	<u>AUD15.40</u>	<u>AUD13.10</u>	<u>AUD13.82</u>
BD USD H (13)	N/A	\$ 12.93	\$ 13.36
BD ZAR H (14)	N/A	R91.01	R95.51
C	<u>¥ 10,880.00</u>	<u>¥ 8,941.00</u>	<u>¥ 8,884.00</u>
C EUR (1)	<u>€ 83.88</u>	<u>€ 70.77</u>	<u>€ 76.09</u>
C EUR H	<u>€ 25.51</u>	<u>€ 21.15</u>	<u>€ 21.31</u>
C USD (1)	<u>\$ 98.97</u>	<u>\$ 84.38</u>	<u>\$ 83.62</u>
I	<u>¥ 13,154.00</u>	<u>¥ 10,672.00</u>	<u>¥ 10,468.00</u>
I EUR (1)	<u>€ 101.40</u>	<u>€ 84.48</u>	<u>€ 89.65</u>
I EUR H	<u>€ 29.65</u>	<u>€ 24.28</u>	<u>€ 24.16</u>
I SGD (1)	<u>SGD160.88</u>	N/A	N/A
I USD (1)	<u>\$ 119.65</u>	<u>\$ 100.72</u>	<u>\$ 98.53</u>
I USD H	<u>\$ 35.77</u>	<u>\$ 28.97</u>	<u>\$ 28.26</u>
S EUR H	<u>€ 29.38</u>	<u>€ 23.77</u>	<u>€ 23.39</u>
S1 (15)	N/A	¥ 11,257.00	¥ 10,993.00
S1 EUR (1)	<u>€ 107.51</u>	<u>€ 89.11</u>	<u>€ 94.15</u>
S1 USD (1)	<u>\$ 126.86</u>	<u>\$ 106.24</u>	<u>\$ 103.47</u>
S1 USD H	<u>\$ 25.78</u>	<u>\$ 20.76</u>	<u>\$ 20.15</u>
SD	<u>¥ 12,815.00</u>	<u>¥ 10,685.00</u>	<u>¥ 10,833.00</u>

	China Low Volatility Equity Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	\$ 153,597,072	\$ 146,211,198	\$ 147,179,581
Klasse			
A	\$ 64.41	\$ 67.15	\$ 53.00
A EUR (1)	€ 54.54	€ 56.28	€ 48.22
A HKD (1)	HKD501.00	N/A	N/A
A PLN H	PLN107.36	PLN113.07	PLN90.71
AD	\$ 19.09	\$ 20.58	\$ 16.90
AD AUD H	AUD17.23	AUD18.76	AUD15.81
AD CAD H	CAD17.80	CAD19.30	CAD16.03
AD EUR H	€ 18.37	€ 19.91	€ 16.44
AD GBP H	£ 18.08	£ 19.61	£ 16.31
AD HKD (1)	HKD148.48	N/A	N/A
AD NZD H	NZD17.67	NZD19.21	NZD16.11
AD RMB H	CNH122.63	CNH132.49	CNH109.12
AD SGD H	SGD18.12	SGD19.59	SGD16.19
AD ZAR H	R116.49	R125.78	R103.78
B	\$ 50.74	\$ 53.42	\$ 42.59
B EUR (1)	€ 42.97	€ 44.77	€ 38.75
BD (16)	N/A	\$ 20.62	\$ 16.91
BD AUD H (17)	N/A	AUD18.74	AUD15.78
BD EUR H (18)	N/A	€ 19.87	€ 16.38
BD NZD H	NZD17.76	NZD19.30	NZD16.10
BD ZAR H	R117.43	R126.91	R104.55
C	\$ 60.34	\$ 63.19	\$ 50.10
C EUR (1)	€ 51.10	€ 52.96	€ 45.58
I	\$ 77.67	\$ 80.33	\$ 62.90
I EUR (1)	€ 65.78	€ 67.33	€ 57.23
S	\$ 97.41	\$ 99.71	\$ 77.00
S1	\$ 86.93	\$ 89.66	\$ 69.84
S1 EUR (1)	€ 73.63	€ 75.15	€ 63.54

	Short Duration Bond Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	\$ 531,284,341	\$ 570,960,697	\$ 570,402,667
Klasse			
A	\$ 7.59	\$ 7.76	\$ 7.86
A EUR (1)	€ 6.43	€ 6.50	€ 7.15
A2	\$ 18.45	\$ 18.44	\$ 18.25
A2 EUR (1)	€ 15.63	€ 15.46	€ 16.60
A2 EUR H	€ 14.48	€ 14.60	€ 14.74
A2 HKD (1)	HKD143.56	N/A	N/A
A2 SGD H	SGD15.59	SGD15.58	SGD15.48
AA	\$ 11.52	\$ 11.94	\$ 12.24
AA AUD H	AUD11.34	AUD11.80	AUD12.13
AA CAD H	CAD11.58	CAD12.02	CAD12.33
AA GBP H	£ 11.53	£ 11.99	£ 12.31
AA HKD (1)	HKD89.65	N/A	N/A
AA NZD H	NZD11.67	NZD12.11	NZD12.44
AA SGD H	SGD11.53	SGD11.96	SGD12.26
AJ	\$ 7.30	\$ 7.45	\$ 7.53

	Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
AR EUR H	€ 11.95	€ 12.39	€ 12.85
AT	\$ 7.58	\$ 7.76	\$ 7.85
AT AUD H	AUD11.81	AUD12.13	AUD12.32
AT CAD H	CAD11.98	CAD12.27	CAD12.43
AT EUR (1)	€ 6.42	€ 6.50	€ 7.14
AT EUR H	€ 11.60	€ 11.88	€ 12.05
AT GBP H	£ 12.07	£ 12.38	£ 12.54
AT HKD (1)	HKD58.97	N/A	N/A
AT NZD H	NZD12.18	NZD12.47	NZD12.65
AT SGD H	SGD12.36	SGD12.65	SGD12.81
AX	\$ 6.06	\$ 6.21	\$ 6.29
B	\$ 7.59	\$ 7.76	\$ 7.86
B2 (19)	N/A	\$ 14.52	\$ 14.51
B2 EUR (1)	€ 12.18	€ 12.17	€ 13.20
BA (20)	N/A	\$ 11.15	\$ 11.55
BAAUD H	N/A	N/A	AUD11.44
BT	\$ 7.63	\$ 7.81	\$ 7.90
BT AUD H (21)	N/A	AUD12.16	AUD12.36
BT CAD H (22)	N/A	CAD12.22	CAD12.38
BT GBP H (23)	N/A	£ 12.39	£ 12.56
BX (24)	N/A	\$ 6.20	\$ 6.28
C	\$ 7.59	\$ 7.76	\$ 7.86
C2	\$ 15.21	\$ 15.26	\$ 15.16
C2 EUR H	€ 13.74	€ 13.91	€ 14.09
I	\$ 7.59	\$ 7.77	\$ 7.86
I EUR (1)	€ 6.43	€ 6.51	€ 7.15
I2	\$ 13.33	\$ 13.25	\$ 13.02
I2 AUD H	AUD20.07	AUD20.00	AUD19.85
I2 EUR (1)	€ 11.29	€ 11.11	€ 11.85
I2 EUR H	€ 15.41	€ 15.44	€ 15.48
IT	\$ 12.46	\$ 12.75	\$ 12.90
IT AUD H	AUD12.35	AUD12.67	AUD12.88
N2	\$ 14.73	\$ 14.79	\$ 14.71
NT	\$ 12.29	\$ 12.57	\$ 12.71
S	\$ 98.58	\$ 100.90	N/A
S EUR H	€ 16.52	€ 16.48	€ 16.45
S SGD H	SGD17.99	SGD17.79	SGD17.49
S1 2	\$ 16.88	\$ 16.74	\$ 16.42
S1 2 EUR (1)	€ 14.29	N/A	N/A
S1 EUR H	€ 15.66	€ 15.66	€ 15.66
SA	\$ 85.58	\$ 87.69	\$ 88.89

	Global High Yield Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 20,805,945,914	\$ 20,280,358,505	\$ 20,563,305,061
Klasse			
A	\$ 3.82	\$ 3.69	\$ 4.00
A EUR (1)	€ 3.23	€ 3.09	€ 3.64
A2	\$ 17.48	\$ 15.81	\$ 15.96
A2 CHF H	CHF16.63	CHF15.24	CHF15.85
A2 EUR (1)	€ 14.80	€ 13.25	€ 14.52
A2 EUR H	€ 25.09	€ 22.92	€ 23.81
A2 HKD (1)	HKD135.99	N/A	N/A
A2 PLN H	PLN108.67	PLN98.88	PLN101.93
A2 SGD (1)	SGD23.52	N/A	N/A
A2 SGD H	SGD22.75	SGD20.60	SGD21.04
AA	\$ 10.47	\$ 10.31	\$ 11.40
AA AUD H	AUD9.91	AUD9.80	AUD11.16
AA CAD H	CAD9.99	CAD9.87	CAD11.07
AA EUR H	€ 10.17	€ 10.03	€ 11.18
AA GBPH	£ 9.99	£ 9.87	£ 11.11
AA HKD (1)	HKD81.46	N/A	N/A
AA NZD H	NZD10.01	NZD9.88	NZD11.16
AA RMB H	CNH68.85	CNH67.73	CNH75.12
AA SGD H	SGD10.26	SGD10.11	SGD11.27
AA ZAR H	R67.97	R66.68	R75.60
AK	\$ 12.43	\$ 12.05	\$ 13.05
AK EUR (1)	€ 10.54	€ 10.10	€ 11.87
AK EUR H	€ 12.24	€ 11.89	€ 13.01
AR EUR H	€ 10.73	€ 10.60	€ 12.00
AT	\$ 3.78	\$ 3.66	\$ 3.97
AT AUD H	AUD12.74	AUD12.39	AUD13.82
AT CAD H	CAD11.63	CAD11.28	CAD12.41
AT EUR (1)	€ 3.20	€ 3.07	€ 3.61
AT EUR H	€ 12.95	€ 12.55	€ 13.74
AT GBPH	£ 12.87	£ 12.50	£ 13.80
AT HKD (1)	HKD29.42	N/A	N/A
AT NZD H	NZD11.75	NZD11.40	NZD12.64
AT RMB H	CNH84.34	CNH81.49	CNH88.64
AT SGD (1)	SGD5.09	N/A	N/A
AT SGD H	SGD11.82	SGD11.44	SGD12.50
B	\$ 3.82	\$ 3.69	\$ 4.00
B2	\$ 25.02	\$ 22.85	\$ 23.30
B2 EUR H (25)	N/A	€ 20.59	€ 21.61
BA	\$ 9.64	\$ 9.58	\$ 10.71
BA AUD H	AUD9.11	AUD9.11	AUD10.48
BA ZAR H	R62.10	R61.54	R70.72
BT	\$ 3.86	\$ 3.73	\$ 4.04
BT AUD H	AUD12.75	AUD12.40	AUD13.80
BT CAD H	CAD11.64	CAD11.28	CAD12.39
BT EUR H	€ 12.98	€ 12.59	€ 13.76
BT GBPH	£ 12.89	£ 12.52	£ 13.81
BT HKD (1)	HKD30.00	N/A	N/A
BT NZD H	NZD11.88	NZD11.52	NZD12.75

	Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
C	\$ 3.82	\$ 3.69	\$ 4.00
C EUR (1)	€ 3.23	€ 3.10	€ 3.64
C2	\$ 24.59	\$ 22.35	\$ 22.67
C2 EUR (1)	€ 20.82	€ 18.73	€ 20.63
C2 EUR H	€ 19.81	€ 18.19	€ 18.98
CK	\$ 12.40	\$ 12.02	\$ 13.01
CK EUR H	€ 12.24	€ 11.87	€ 13.00
CT	\$ 12.86	\$ 12.44	\$ 13.48
EA	\$ 12.66	\$ 12.53	\$ 13.92
EA AUD H	AUD13.18	AUD13.11	AUD15.00
EA ZAR H	R89.01	R87.81	R100.06
I	\$ 3.82	\$ 3.69	\$ 4.00
I EUR (1)	€ 3.23	€ 3.09	€ 3.64
I2	\$ 11.17	\$ 10.05	\$ 10.10
I2 AUD H	AUD30.10	AUD27.21	AUD28.23
I2 CHF H	CHF17.20	CHF15.68	CHF16.21
I2 EUR (1)	€ 9.46	€ 8.43	€ 9.19
I2 EUR H	€ 26.61	€ 24.19	€ 25.01
I2 SGD (1)	SGD15.03	N/A	N/A
I2 SGD H	SGD19.69	SGD17.74	SGD18.03
IA AUD H	AUD12.60	AUD12.41	AUD14.04
IQD	\$ 12.16	\$ 11.78	\$ 12.78
IQD EUR (1)	€ 10.30	€ 9.87	€ 11.63
IT	\$ 11.88	\$ 11.49	\$ 12.47
IT AUD H	AUD11.32	AUD11.00	AUD12.29
IT CAD H	CAD13.85	CAD13.44	CAD14.81
IT EUR H	€ 12.85	€ 12.46	€ 13.65
IT GBP H	£ 13.81	£ 13.42	£ 14.83
IT HKD (1)	HKD92.38	N/A	N/A
IT NZD H	NZD13.73	NZD13.33	NZD14.78
IT RMB H	CNH80.53	CNH77.82	CNH84.72
J	\$ 4.11	\$ 3.97	\$ 4.30
N2	\$ 20.26	\$ 18.43	\$ 18.70
NT	\$ 12.17	\$ 11.77	\$ 12.75
S EUR H (26)	N/A	€ 106.45	€ 108.75
S1	\$ 30.03	\$ 26.99	\$ 27.02
S1 EUR (1)	€ 25.43	€ 22.62	€ 24.58
S1D	\$ 17.98	\$ 16.85	\$ 17.79
SA	\$ 80.17	\$ 77.65	\$ 84.33
SHK	\$ 88.60	\$ 85.84	\$ 93.16
SK	\$ 40.34	\$ 36.16	\$ 36.12
SQ (27)	N/A	\$ 95.19	\$ 103.97
W	\$ 14.39	\$ 13.96	N/A
W EUR (1)	€ 12.19	€ 11.70	N/A
W2	\$ 17.27	\$ 15.52	\$ 15.55
W2 CHF H	CHF15.66	CHF14.27	CHF14.72
W2 EUR H	€ 16.02	€ 14.53	N/A
WT	\$ 13.10	\$ 12.69	\$ 13.78
WT AUD H	AUD12.59	AUD12.26	AUD13.69

Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)			
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
WT CAD H	<u>CAD14.06</u>	<u>CAD13.66</u>	<u>N/A</u>
WT EUR H	<u>€ 12.90</u>	<u>€ 12.53</u>	<u>€ 13.73</u>
WT GBP H	<u>£ 13.99</u>	<u>£ 13.61</u>	<u>N/A</u>
WT RMB H	<u>CNH95.08</u>	<u>CNH92.01</u>	<u>N/A</u>
American Income Portfolio			
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	<u>\$ 24,837,439,539</u>	<u>\$ 28,197,385,467</u>	<u>\$ 23,009,132,001</u>
Klasse			
A	<u>\$ 8.12</u>	<u>\$ 8.17</u>	<u>\$ 8.39</u>
A EUR (1)	<u>€ 6.88</u>	<u>€ 6.85</u>	<u>€ 7.63</u>
A2	<u>\$ 32.84</u>	<u>\$ 31.47</u>	<u>\$ 30.66</u>
A2 CHF H	<u>CHF17.19</u>	<u>CHF16.67</u>	<u>CHF16.74</u>
A2 DUR PH	<u>\$ 18.86</u>	<u>\$ 17.89</u>	<u>\$ 17.83</u>
A2 EUR (1)	<u>€ 27.81</u>	<u>€ 26.37</u>	<u>€ 27.90</u>
A2 EUR H	<u>€ 20.47</u>	<u>€ 19.80</u>	<u>€ 19.82</u>
A2 HKD (1)	<u>HKD255.44</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
A2 PLN H	<u>PLN109.95</u>	<u>PLN105.80</u>	<u>PLN104.94</u>
A2 SGD (1)	<u>SGD44.19</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
A2 SGD H	<u>SGD22.30</u>	<u>SGD21.39</u>	<u>SGD21.02</u>
AA	<u>\$ 12.51</u>	<u>\$ 12.75</u>	<u>\$ 13.27</u>
AA AUD H	<u>AUD12.08</u>	<u>AUD12.36</u>	<u>AUD13.10</u>
AA CAD H	<u>CAD11.97</u>	<u>CAD12.23</u>	<u>CAD12.85</u>
AA DUR PH	<u>\$ 11.59</u>	<u>\$ 11.69</u>	<u>\$ 12.48</u>
AA EUR H	<u>€ 12.02</u>	<u>€ 12.27</u>	<u>€ 12.87</u>
AA GBP H	<u>£ 11.89</u>	<u>£ 12.16</u>	<u>£ 12.84</u>
AA HKD (1)	<u>HKD97.28</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
AA NZD H	<u>NZD11.99</u>	<u>NZD12.25</u>	<u>NZD12.93</u>
AA RMB H	<u>CNH81.62</u>	<u>CNH83.13</u>	<u>CNH86.71</u>
AA SGD H	<u>SGD12.23</u>	<u>SGD12.47</u>	<u>SGD13.05</u>
AA ZAR H	<u>R82.71</u>	<u>R83.92</u>	<u>R88.02</u>
AK	<u>\$ 13.53</u>	<u>\$ 13.62</u>	<u>\$ 13.97</u>
AK EUR (1)	<u>€ 11.46</u>	<u>€ 11.42</u>	<u>€ 12.71</u>
AK EUR H	<u>€ 13.36</u>	<u>€ 13.46</u>	<u>€ 13.95</u>
AR EUR	<u>€ 12.00</u>	<u>€ 12.13</u>	<u>€ 13.74</u>
AR EUR H	<u>€ 12.21</u>	<u>€ 12.48</u>	<u>€ 13.26</u>
AT	<u>\$ 8.12</u>	<u>\$ 8.16</u>	<u>\$ 8.38</u>
AT AUD H	<u>AUD13.51</u>	<u>AUD13.64</u>	<u>AUD14.26</u>
AT CAD H	<u>CAD13.43</u>	<u>CAD13.53</u>	<u>CAD14.02</u>
AT DUR PH	<u>\$ 12.95</u>	<u>\$ 12.89</u>	<u>\$ 13.57</u>
AT EUR (1)	<u>€ 6.87</u>	<u>€ 6.84</u>	<u>€ 7.62</u>
AT EUR H	<u>€ 13.45</u>	<u>€ 13.54</u>	<u>€ 14.01</u>
AT GBP H	<u>£ 13.33</u>	<u>£ 13.46</u>	<u>£ 13.98</u>
AT HKD (1)	<u>HKD63.13</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
AT NZD H	<u>NZD12.85</u>	<u>NZD12.96</u>	<u>NZD13.48</u>
AT RMB H	<u>CNH91.05</u>	<u>CNH91.47</u>	<u>CNH93.99</u>
AT SGD (1)	<u>SGD10.92</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
AT SGD H	<u>SGD13.52</u>	<u>SGD13.62</u>	<u>SGD14.04</u>
B	<u>\$ 8.12</u>	<u>\$ 8.17</u>	<u>\$ 8.39</u>
B2	<u>\$ 26.09</u>	<u>\$ 25.17</u>	<u>\$ 24.70</u>

	American Income Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
B2 HKD (1)	<u>HKD202.95</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
BA	<u>\$ 11.82</u>	<u>\$ 12.13</u>	<u>\$ 12.73</u>
BA AUD H	<u>AUD11.38</u>	<u>AUD11.74</u>	<u>AUD12.54</u>
BA ZAR H	<u>R78.64</u>	<u>R80.27</u>	<u>R84.90</u>
BT	<u>\$ 8.18</u>	<u>\$ 8.23</u>	<u>\$ 8.44</u>
BT AUD H	<u>AUD13.59</u>	<u>AUD13.72</u>	<u>AUD14.33</u>
BT CAD H	<u>CAD13.31</u>	<u>CAD13.42</u>	<u>CAD13.90</u>
BT EUR (1)	<u>€ 6.93</u>	<u>€ 6.90</u>	<u>€ 7.68</u>
BT EUR H	<u>€ 13.45</u>	<u>€ 13.55</u>	<u>€ 14.01</u>
BT GBP H	<u>£ 13.43</u>	<u>£ 13.55</u>	<u>£ 14.08</u>
BT HKD (1)	<u>HKD63.64</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
BT NZD H	<u>NZD12.92</u>	<u>NZD13.02</u>	<u>NZD13.55</u>
C	<u>\$ 8.12</u>	<u>\$ 8.17</u>	<u>\$ 8.39</u>
C EUR (1)	<u>€ 6.88</u>	<u>€ 6.85</u>	<u>€ 7.63</u>
C2	<u>\$ 39.93</u>	<u>\$ 38.44</u>	<u>\$ 37.62</u>
C2 DUR PH	<u>\$ 18.16</u>	<u>\$ 17.30</u>	<u>\$ 17.32</u>
C2 EUR (1)	<u>€ 33.82</u>	<u>€ 32.21</u>	<u>€ 34.23</u>
C2 EUR H	<u>€ 19.51</u>	<u>€ 18.95</u>	<u>€ 19.06</u>
CT	<u>\$ 13.59</u>	<u>\$ 13.67</u>	<u>\$ 14.03</u>
EA	<u>\$ 14.38</u>	<u>\$ 14.73</u>	<u>\$ 15.42</u>
EA AUD H	<u>AUD14.02</u>	<u>AUD14.43</u>	<u>AUD15.37</u>
EA ZAR H	<u>R95.55</u>	<u>R97.34</u>	<u>R102.73</u>
I	<u>\$ 8.12</u>	<u>\$ 8.17</u>	<u>\$ 8.39</u>
I EUR (1)	<u>€ 6.88</u>	<u>€ 6.85</u>	<u>€ 7.63</u>
I2	<u>\$ 19.61</u>	<u>\$ 18.68</u>	<u>\$ 18.10</u>
I2 AUD H	<u>AUD17.29</u>	<u>AUD16.54</u>	<u>AUD16.42</u>
I2 CHF H	<u>CHF18.03</u>	<u>CHF17.40</u>	<u>CHF17.37</u>
I2 DUR PH	<u>\$ 19.49</u>	<u>\$ 18.39</u>	<u>\$ 18.23</u>
I2 EUR (1)	<u>€ 16.60</u>	<u>€ 15.66</u>	<u>€ 16.47</u>
I2 EUR H	<u>€ 22.17</u>	<u>€ 21.32</u>	<u>€ 21.24</u>
I2 HKD (1)	<u>HKD152.50</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
I2 SGD (1)	<u>SGD26.38</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
I2 SGD H	<u>SGD19.96</u>	<u>SGD19.04</u>	<u>SGD18.62</u>
IA	<u>\$ 14.30</u>	<u>\$ 14.50</u>	<u>\$ 15.01</u>
IA AUD H	<u>AUD13.89</u>	<u>AUD14.13</u>	<u>AUD14.89</u>
IT	<u>\$ 13.25</u>	<u>\$ 13.33</u>	<u>\$ 13.68</u>
IT AUD H	<u>AUD12.64</u>	<u>AUD12.76</u>	<u>AUD13.34</u>
IT CAD H	<u>CAD14.64</u>	<u>CAD14.77</u>	<u>CAD15.31</u>
IT EUR H	<u>€ 14.65</u>	<u>€ 14.75</u>	<u>€ 15.26</u>
IT GBP H	<u>£ 14.57</u>	<u>£ 14.70</u>	<u>£ 15.27</u>
IT HKD (1)	<u>HKD103.07</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
IT JPY	<u>¥ 9,954.00</u>	<u>¥ 9,632.00</u>	<u>¥ 9,905.00</u>
IT JPY H	<u>¥ 8,565.00</u>	<u>¥ 8,619.00</u>	<u>¥ 8,890.00</u>
IT NZD H	<u>NZD14.60</u>	<u>NZD14.72</u>	<u>NZD15.30</u>
IT RMB H	<u>CNH99.14</u>	<u>CNH99.66</u>	<u>CNH102.14</u>
IT SGD (1)	<u>SGD17.83</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
IT SGD H	<u>SGD13.68</u>	<u>SGD13.77</u>	<u>SGD14.19</u>
J	<u>\$ 8.28</u>	<u>\$ 8.33</u>	<u>\$ 8.55</u>
L2	<u>\$ 16.22</u>	<u>\$ 15.50</u>	<u>N/A</u>
L2 AUD H	<u>AUD15.78</u>	<u>AUD15.13</u>	<u>N/A</u>

		American Income Portfolio (Fortsetzung)		
		31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
L2 SGD H	SGD16.06	SGD15.36	N/A
LT	\$ 14.66	\$ 14.75	N/A
LT AUD H	AUD14.43	AUD14.57	N/A
LT SGD H	SGD14.69	SGD14.79	N/A
N2	\$ 19.38	\$ 18.67	\$ 18.29
NT	\$ 13.21	\$ 13.29	\$ 13.64
S	\$ 22.65	\$ 21.43	\$ 20.61
S1	\$ 25.33	\$ 24.08	\$ 23.28
S1 EUR (1)	€ 21.45	€ 20.18	€ 21.18
S1D	\$ 16.32	\$ 16.16	\$ 16.27
S1D2	\$ 96.17	\$ 96.73	N/A
SA	\$ 91.74	\$ 92.31	\$ 94.74
SHK	\$ 95.32	\$ 95.92	\$ 98.43
W	\$ 14.62	\$ 14.71	\$ 15.10
W2	\$ 18.07	\$ 17.19	\$ 16.63
W2 CHF H	CHF16.39	CHF15.79	CHF15.74
W2 EUR H	€ 16.61	€ 15.96	€ 15.85
WT	\$ 14.64	\$ 14.72	\$ 15.11
WT AUD H	AUD14.23	AUD14.37	AUD15.02
WT EUR H	€ 14.73	€ 14.83	€ 15.34
WT GBPH	£ 14.54	£ 14.67	£ 15.32
WT HKD (1)	HKD113.86	N/A	N/A
WT SGD H	SGD14.53	SGD14.63	SGD15.08
		European Income Portfolio		
		31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	€ 2,245,496,354	€2,426,429,717	€4,015,417,264
Klasse				
A	€ 6.87	€ 6.78	€ 7.04
A USD (1)	\$ 8.11	\$ 8.09	\$ 7.74
A2	€ 22.14	€ 21.14	€ 21.25
A2 CHF H	CHF16.97	CHF16.26	CHF16.38
A2 PLN H	PLN110.81	PLN105.30	PLN104.80
A2 SGD H	SGD19.17	SGD18.16	SGD17.96
A2 USD (1)	\$ 26.14	\$ 25.22	\$ 23.36
A2 USD H	\$ 19.86	\$ 18.81	\$ 18.45
AA	€ 12.63	€ 12.65	€ 13.32
AA AUD H	AUD12.39	AUD12.42	AUD13.27
AA HKD H	HKD83.93	HKD84.16	HKD88.25
AA RMB H	CNH84.11	CNH84.01	CNH88.08
AA SGD H	SGD12.52	SGD12.51	SGD13.19
AA USD H	\$ 12.75	\$ 12.75	\$ 13.38
AK	€ 14.49	€ 14.30	€ 14.85
AR	€ 12.48	€ 12.52	€ 13.21
AT	€ 6.88	€ 6.78	€ 7.05
AT AUD H	AUD14.70	AUD14.53	AUD15.30
AT SGD H	SGD13.98	SGD13.76	SGD14.31
AT USD (1)	\$ 8.12	\$ 8.09	\$ 7.75

	European Income Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
AT USD H	\$ 15.06	\$ 14.84	\$ 15.35
B (28)	N/A	€ 6.78	€ 7.04
B USD (1)	\$ 8.11	\$ 8.09	\$ 7.74
B2	€ 18.98	€ 18.25	€ 18.47
B2 USD (1)	\$ 22.41	\$ 21.77	\$ 20.30
BA	€ 11.95	€ 12.05	€ 12.79
BA AUD H	AUD11.72	AUD11.84	AUD12.75
BA USD H	\$ 12.06	\$ 12.16	\$ 12.85
BT	€ 6.88	€ 6.78	€ 7.05
BT AUD H	AUD14.74	AUD14.57	AUD15.34
BT USD (1)	\$ 8.12	\$ 8.09	\$ 7.75
BT USD H	\$ 15.06	\$ 14.84	\$ 15.35
C	€ 6.87	€ 6.78	€ 7.04
C USD (1)	\$ 8.11	\$ 8.09	\$ 7.74
C2	€ 20.94	€ 20.09	€ 20.27
C2 USD (1)	\$ 24.73	\$ 23.97	\$ 22.28
C2 USD H	\$ 18.95	\$ 18.02	\$ 17.76
CK	€ 14.47	€ 14.28	€ 14.84
CT USD H	\$ 13.88	\$ 13.68	\$ 14.15
I	€ 6.87	€ 6.78	€ 7.04
I USD (1)	\$ 8.11	\$ 8.09	\$ 7.74
I2	€ 14.84	€ 14.09	€ 14.09
I2 AUD H	AUD31.88	AUD30.13	AUD30.10
I2 CHF H	CHF17.29	CHF16.73	CHF16.75
I2 USD (1)	\$ 17.52	\$ 16.81	\$ 15.49
I2 USD H	\$ 28.28	\$ 26.62	\$ 25.97
IA	€ 13.86	€ 13.79	€ 14.45
IA HKD H	HKD92.75	HKD92.47	HKD96.30
IA SGD H	SGD13.82	SGD13.72	SGD14.39
IA USD H	\$ 14.05	\$ 13.97	\$ 14.57
IT	€ 14.54	€ 14.34	€ 14.90
IT SGD H	SGD14.53	SGD14.29	SGD14.85
IT USD H	\$ 14.29	\$ 14.07	\$ 14.55
NT USD H	\$ 14.59	\$ 14.38	\$ 14.87
S (29)	N/A	€ 114.26	€ 113.36
S1	€ 24.30	€ 23.03	€ 22.95
S1 USD (1)	\$ 28.69	\$ 27.48	\$ 25.22
S1 USD H	\$ 26.49	\$ 24.89	\$ 24.23
S1D	€ 14.39	€ 14.20	€ 14.75
SA USD H	\$ 94.84	\$ 93.62	\$ 96.97
SHK	€ 94.85	€ 93.55	€ 97.23
W2	€ 15.98	€ 15.16	N/A
W2 CHF H	CHF16.63	CHF15.82	CHF15.82
W2 USD H	\$ 16.46	\$ 15.47	N/A
WA	€ 14.63	€ 14.53	N/A
WA HKD H	HKD97.78	HKD97.28	N/A
WA USD H	\$ 14.71	\$ 14.60	N/A
WT	€ 14.82	€ 14.62	N/A
WT SGD H	SGD14.84	SGD14.60	N/A
WT USD H	\$ 14.91	\$ 14.68	N/A

	Emerging Markets Debt Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen.....	\$ 870,118,646	\$ 941,712,812	\$ 980,277,618
Klasse			
A	\$ 14.52	\$ 14.41	\$ 14.69
A EUR (1)	€ 12.30	€ 12.08	€ 13.37
A2	\$ 36.18	\$ 34.23	\$ 32.87
A2 CHF H	CHF16.46	CHF15.78	CHF15.60
A2 EUR (1)	€ 30.64	€ 28.69	€ 29.91
A2 EUR H	€ 22.31	€ 21.34	€ 21.05
A2 HKD (1)	HKD281.39	N/A	N/A
A2 PLN (1)	PLN138.56	N/A	N/A
A2 PLN H	PLN110.09	PLN105.14	PLN103.07
A2 SGD H	SGD22.64	SGD21.46	SGD20.87
AA	\$ 12.19	\$ 12.27	\$ 12.68
AA AUD H	AUD11.50	AUD11.65	AUD12.42
AA CAD H	CAD11.27	CAD11.39	CAD11.94
AA EUR H	€ 11.45	€ 11.56	€ 12.03
AA GBP H	£ 11.25	£ 11.39	£ 12.00
AA HKD (1)	HKD94.81	N/A	N/A
AA NZD H	NZD11.20	NZD11.31	NZD11.98
AA RMB H	CNH85.67	CNH86.21	CNH89.19
AA SGD H	SGD11.88	SGD11.97	SGD12.47
AA ZAR H	R78.80	R79.14	R83.46
AI (30)	\$ 74.73	N/A	N/A
AI AUD H (30)	AUD74.55	N/A	N/A
AR EUR	€ 11.88	€ 11.85	€ 13.36
AT	\$ 14.58	\$ 14.47	\$ 14.75
AT AUD H	AUD12.88	AUD12.87	AUD13.53
AT CAD H	CAD11.79	CAD11.74	CAD12.14
AT EUR (1)	€ 12.35	€ 12.13	€ 13.42
AT EUR H	€ 13.38	€ 13.31	€ 13.66
AT GBP H	£ 11.83	£ 11.81	£ 12.27
AT HKD (1)	HKD113.43	N/A	N/A
AT NZD H	NZD11.52	NZD11.48	NZD11.98
AT RMB H	CNH88.59	CNH87.93	CNH89.62
AT SGD H	SGD12.83	SGD12.76	SGD13.10
B (31)	N/A	\$ 14.41	\$ 14.69
B2 (32)	N/A	\$ 29.62	\$ 28.74
B2 EUR (1)	€ 26.25	€ 24.83	€ 26.15
B2 HKD (1)	HKD241.14	N/A	N/A
BA	\$ 11.25	\$ 11.43	\$ 11.95
BA AUD H	AUD10.63	AUD10.87	AUD11.69
BA ZAR H	R72.43	R73.48	R78.22
BT	\$ 14.54	\$ 14.43	\$ 14.70
BT AUD H	AUD12.90	AUD12.87	AUD13.51
BT CAD H (33)	N/A	CAD11.74	CAD12.13
BT EUR H	€ 13.41	€ 13.33	€ 13.67
BT GBP H (34)	N/A	£ 11.77	£ 12.23
BT HKD (1)	HKD113.12	N/A	N/A
BT NZD H (35)	N/A	NZD11.55	NZD12.05

	Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
C	\$ 14.53	\$ 14.41	\$ 14.69
C EUR (1)	€ 12.30	€ 12.08	€ 13.37
C2	\$ 33.72	\$ 32.04	\$ 30.92
C2 EUR (1)	€ 28.55	€ 26.86	€ 28.13
C2 EUR H	€ 21.29	€ 20.45	€ 20.26
CT	\$ 12.34	\$ 12.25	\$ 12.48
EA	\$ 14.35	\$ 14.52	N/A
EA AUD H	AUD13.88	AUD14.14	N/A
EA ZAR H	R94.15	R94.99	N/A
EI (30)	\$ 74.50	N/A	N/A
EI AUD H (30)	AUD74.36	N/A	N/A
I	\$ 14.53	\$ 14.42	\$ 14.69
I2	\$ 39.36	\$ 37.03	\$ 35.37
I2 CHF H	CHF17.27	CHF16.47	CHF16.19
I2 EUR (1)	€ 33.33	€ 31.03	€ 32.18
I2 EUR H	€ 23.84	€ 22.67	€ 22.24
IT (36)	N/A	\$ 12.24	\$ 12.47
IT AUD H	AUD11.57	AUD11.55	AUD12.15
IT EUR H	€ 12.79	€ 12.74	€ 13.07
IT SGD H	SGD12.01	SGD11.94	SGD12.26
N2	\$ 18.68	\$ 17.77	\$ 17.16
NT	\$ 11.99	\$ 11.89	\$ 12.12
S	\$ 38.83	\$ 36.28	\$ 34.41
S EUR H	€ 24.53	€ 23.15	€ 22.54
S GBP H	£ 25.92	£ 24.34	£ 23.76
S1 2	\$ 36.52	\$ 34.31	\$ 32.73
S1 2 EUR (1)	€ 30.93	€ 28.76	€ 29.78
S1 EUR H	€ 23.04	€ 21.86	€ 21.40
S1 GBP H	£ 24.36	£ 23.01	£ 22.58
S1QD EUR H	€ 98.69	€ 98.17	N/A
SA	\$ 89.53	\$ 88.93	\$ 90.71

	Mortgage Income Portfolio		
	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
Nettovermögen	\$ 1,493,772,913	\$1,322,589,619	\$1,740,744,013
Klasse			
A	\$ 12.18	\$ 12.00	\$ 13.78
A2	\$ 18.33	\$ 17.03	\$ 18.40
A2 EUR (1)	€ 15.52	€ 14.27	€ 16.74
A2 HKD (1)	HKD142.59	N/A	N/A
A2 SGD (1)	SGD24.67	N/A	N/A
A2X	\$ 13.13	\$ 12.19	\$ 13.16
A2X EUR (1)	€ 11.12	€ 10.22	€ 11.97
AA	\$ 10.91	\$ 10.89	\$ 12.70
AA AUD H	AUD10.55	AUD10.58	AUD12.56
AA HKD (1)	HKD84.83	N/A	N/A
AA RMB H	CNH74.47	CNH74.25	CNH86.99
AA SGD H	SGD10.79	SGD10.78	SGD12.64

Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)

	31. August 2021	31. August 2020	31. August 2019
AA ZAR H	<u>R72.79</u>	<u>R72.23</u>	<u>R85.50</u>
AR EUR H	<u>€ 10.87</u>	<u>€ 10.88</u>	<u>€ 12.99</u>
AT	<u>\$ 12.21</u>	<u>\$ 12.03</u>	<u>\$ 13.82</u>
AT AUD H	<u>AUD11.86</u>	<u>AUD11.73</u>	<u>AUD13.72</u>
AT EUR (1)	<u>€ 10.34</u>	<u>€ 10.08</u>	<u>€ 12.57</u>
AT GBP H	<u>£ 12.77</u>	<u>£ 12.62</u>	<u>£ 14.70</u>
AT HKD (1)	<u>HKD94.97</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
AT SGD (1)	<u>SGD16.43</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
AT SGD H	<u>SGD12.07</u>	<u>SGD11.89</u>	<u>SGD13.74</u>
AX	<u>\$ 5.90</u>	<u>\$ 5.81</u>	<u>\$ 6.68</u>
AX EUR (1)	<u>€ 5.00</u>	<u>€ 4.87</u>	<u>€ 6.08</u>
B2X	<u>\$ 12.41</u>	<u>\$ 11.58</u>	<u>\$ 12.56</u>
BA (37)	<u>N/A</u>	<u>\$ 10.14</u>	<u>\$ 11.95</u>
BA AUD H (38)	<u>N/A</u>	<u>AUD9.85</u>	<u>AUD11.82</u>
BA ZAR H (39)	<u>N/A</u>	<u>R67.40</u>	<u>R80.50</u>
BX	<u>\$ 5.90</u>	<u>\$ 5.81</u>	<u>\$ 6.68</u>
BX EUR (1)	<u>€ 5.00</u>	<u>€ 4.87</u>	<u>€ 6.08</u>
C	<u>\$ 12.20</u>	<u>\$ 12.01</u>	<u>\$ 13.79</u>
C2	<u>\$ 17.69</u>	<u>\$ 16.51</u>	<u>\$ 17.92</u>
C2 EUR (1)	<u>€ 14.98</u>	<u>N/A</u>	<u>N/A</u>
C2X	<u>\$ 17.53</u>	<u>\$ 16.35</u>	<u>\$ 17.73</u>
CX	<u>\$ 5.90</u>	<u>\$ 5.81</u>	<u>\$ 6.68</u>
I	<u>\$ 12.19</u>	<u>\$ 12.01</u>	<u>\$ 13.80</u>
I EUR (1)	<u>€ 10.32</u>	<u>€ 10.07</u>	<u>€ 12.56</u>
I2	<u>\$ 19.10</u>	<u>\$ 17.65</u>	<u>\$ 18.96</u>
I2 EUR (1)	<u>€ 16.17</u>	<u>€ 14.79</u>	<u>€ 17.25</u>
I2 EUR H	<u>€ 14.93</u>	<u>€ 13.93</u>	<u>€ 15.39</u>
I2X	<u>\$ 11.75</u>	<u>\$ 10.85</u>	<u>\$ 11.65</u>
IT EUR H	<u>€ 12.89</u>	<u>€ 12.71</u>	<u>€ 14.72</u>
IX	<u>\$ 5.90</u>	<u>\$ 5.81</u>	<u>\$ 6.68</u>
N2	<u>\$ 15.42</u>	<u>\$ 14.40</u>	<u>\$ 15.65</u>
NT	<u>\$ 13.00</u>	<u>\$ 12.80</u>	<u>\$ 14.69</u>
S	<u>\$ 12.16</u>	<u>\$ 11.97</u>	<u>\$ 13.78</u>
S1	<u>\$ 17.76</u>	<u>\$ 16.38</u>	<u>\$ 17.57</u>
S1 EUR (1)	<u>€ 15.04</u>	<u>€ 13.73</u>	<u>€ 15.99</u>
S1 EUR H	<u>€ 97.54</u>	<u>€ 90.81</u>	<u>N/A</u>
S1 JPY	<u>¥ 10.291.00</u>	<u>¥ 9.138.00</u>	<u>¥ 9.831.00</u>
S1X	<u>\$ 5.90</u>	<u>\$ 5.81</u>	<u>\$ 6.68</u>
SA	<u>\$ 79.92</u>	<u>\$ 78.76</u>	<u>\$ 90.64</u>

(1) Auflegungsdatum 16. Juli 2021. Die vor der Auflegung genannte Wertentwicklung ist synthetisch.

(2) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem abschließenden NAV von \$19.69

(3) Aufgelöst am 15. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von \$39.21

(4) Aufgelöst am 20. August 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD15.41

(5) Aufgelöst am 20. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von €16.02

(6) Aufgelöst am 20. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von R102.39

(7) Auflegungsdatum 12. Mai 2021

(8) Aufgelöst am 30. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von £15.91

-
- (9) Aufgelöst am 19. Februar 2021 mit einem abschließenden NAV von ¥12,350.00
- (10) Aufgelöst am 15. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von ¥10,253.00
- (11) Auflegungsdatum 16. Juli 2021 und aufgelöst am 20. August 2021 mit einem abschließenden NAV von €75.19. Die vor der Auflegung genannte Wertentwicklung ist synthetisch
- (12) Aufgelöst am 21. Juni 2021 mit einem abschließenden NAV von ¥12,069.00
- (13) Aufgelöst am 20. August 2021 mit einem abschließenden NAV von \$1,621.15
- (14) Aufgelöst am 21. Juni 2021 mit einem abschließenden NAV von R111.96
- (15) Aufgelöst am 15. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von ¥14,197.00
- (16) Aufgelöst am 20. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von \$20.63
- (17) Aufgelöst am 20. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD18.63
- (18) Aufgelöst am 21. Juni 2021 mit einem abschließenden NAV von €20.37
- (19) Aufgelöst am 15. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von \$14.39
- (20) Aufgelöst am 22. März 2021 mit einem abschließenden NAV von \$10.87
- (21) Aufgelöst am 31. März 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD11.97
- (22) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem abschließenden NAV von CAD12.20
- (23) Aufgelöst am 31. März 2021 mit einem abschließenden NAV von £12.19
- (24) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem abschließenden NAV von \$6.16
- (25) Aufgelöst am 31. März 2021 mit einem abschließenden NAV von €21.57
- (26) Aufgelöst am 29. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von €117.56
- (27) Aufgelöst am 15. Juni 2021 mit einem abschließenden NAV von \$99.19
- (28) Aufgelöst am 15. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von €6.87
- (29) Aufgelöst am 17. August 2021 mit einem abschließenden NAV von €121.55
- (30) Auflegungsdatum 5. März 2021
- (31) Aufgelöst am 29. Januar 2021 mit einem abschließenden NAV von \$14.68
- (32) Aufgelöst am 15. Juli 2021 mit einem abschließenden NAV von \$30.56
- (33) Aufgelöst am 31. März 2021 mit einem abschließenden NAV von CAD11.35
- (34) Aufgelöst am 31. März 2021 mit einem abschließenden NAV von £11.35
- (35) Aufgelöst am 31. März 2021 mit einem abschließenden NAV von NZD11.16
- (36) Aufgelöst am 25. Mai 2021 mit einem abschließenden NAV von \$12.23
- (37) Aufgelöst am 20. April 2021 mit einem abschließenden NAV von \$10.24
- (38) Aufgelöst am 22. März 2021 mit einem abschließenden NAV von AUD9.95
- (39) Aufgelöst am 20. Mai 2021 mit einem abschließenden NAV von R68.48

ANMERKUNG A: Allgemeine Informationen

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

Der Fonds besteht aus getrennten Anlagevermögen mit derzeit 15 aktiven Portefeuilles (einzeln das „Portefeuille“ und zusammengenommen die „Portefeuilles“). Jede Anteilklasse stellt eine Beteiligung an den Anlagewertpapieren sowie anderen Nettovermögenswerten des entsprechenden Portefeuilles dar. Alle Anteile einer Klasse haben dieselben Rechte in Bezug auf Ausschüttungen und Rücknahmen.

Ab Ende 2019 und auch bis 2021 weitete sich der Ausbruch des neuen Coronavirus, das eine als COVID-19 bekannte Krankheit verursacht, zu einer globalen Pandemie aus. Die zunehmenden

Turbulenzen aufgrund der Ausbreitung des Coronavirus und das Potenzial für dauerhafte und erhebliche negative Auswirkungen auf die Weltwirtschaft haben zu einer erhöhten Marktvolatilität geführt, die sich im weiteren Verlauf der Pandemie und ihrer Folgen wiederholen kann.

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

Der Verwaltungsrat hat beschlossen, bestimmte Anteilklassen der folgenden Portefeuilles zum 15. Juli 2021 aufzuteilen: AB FCP I - American Income Portfolio, AB FCP I - Asia Ex-Japan Equity Portfolio, AB FCP I - China Low Volatility Equity Portfolio, AB FCPI - Dynamic Diversified Portfolio, AB FCPI - Emerging Market Debt Portfolio, AB FCPI - Emerging Markets Growth Portfolio, AB FCP I - European Income Portfolio, AB FCP I - Global Equity Blend Portfolio, AB FCP I - Global High Yield Portfolio, AB FCP I - Global Value Portfolio, AB FCP I - Japan Strategic Value Portfolio, AB FCP I - Mortgage Income Portfolio, AB FCP I - Short Duration Bond Portfolio und AB FCP I - Sustainable US Thematic Portfolio.

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

AB FCP I-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
Dynamic Diversified Portfolio	2. November 2004	A, A EUR, A EUR H, AX, AX EUR, AX SGD, BX, BX SGD, C, C EUR, C EUR H, CX, I, I EUR, I EUR H, IX & S1 EUR H
Global Equity Blend Portfolio	1. September 2003	A, A EUR, A EUR H, A SGD, B, B SGD, C, C EUR, I, I EUR, S HKD, S1, S1 EUR, S1 GBP & S1 SGD
Global Value Portfolio	1. Juni 2006	A, A EUR, A SGD, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD SGD H, AD ZAR H, B, BD, C, C EUR, I, I EUR, I SGD, S, S GBP, S GBP H, S1, S1 EUR, S1 GBP & SD
Emerging Markets Growth Portfolio	30. Oktober 1992	A, A AUD H, A EUR, A HKD, A PLN H, A SGD, A SGD H, AD, B, C, C AUD H, C EUR, ED, I, I AUD H, I EUR, N, S, S1, S1 EUR & S1GBP
Sustainable US Thematic Portfolio	1. Juni 2006	A, A AUD H, A CAD H, A EUR, A EUR H, A GBP H, A HKD, A SGD H, AN, B, C, C EUR, C EUR H, C SGD, E, I, I EUR, I EUR H, I GBP, IN, IN EUR, S, S1, S1 EUR & S1 JPY H
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	30. November 2009	A, A AUD H, A EUR, A HKD, A SGD H, AD, AD AUD H, AD CAD H, AD EUR, AD EUR H, AD GBP H, AD HKD, AD NZD H, AD RMB H, AD SGD H, AD ZAR H, AY JPY, BD, BD AUD H, BD CAD H, BD HKD, BD NZD H, BD ZAR H, BY JPY, C, C AUD H, C EUR, ED, I, I AUD H, I EUR, I GBP, ID, ID AUD H, S, S HKD, S1, S1 EUR & SD

AB FCPI-	Geschäftsaufnahme	Angeborene Anteilklassen
Japan Strategic Value Portfolio	15. Dezember 2005	A, A AUD H, A CZK H, A EUR, A EUR H, A NZD H, A PLN, A SGD, A SGD H, A USD, A USD H, AD, AD AUD H, AD NZD H, AD USD H, AD ZAR, H, BD AUD H, C, C EUR, C EUR H, C USD, I, I EUR, I EUR H, I SGD, I USD, I USD H, S EUR H, S1 EUR, S1 USD, S1 USD H & SD
China Low Volatility Equity Portfolio	1. Februar 2007	A, A EUR, A HKD, A PLN H, 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, B, B EUR, BD NZD H, BD ZAR H, C, C EUR, I, I EUR, S, S1 & S1 EUR
Short Duration Bond Portfolio	16. September 1996	A, A EUR, A2, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA GBP H, AA HKD, AA NZD H, AA SGD H, AJ, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT SGD H, AX, B, B2 EUR, BT, C, C2, C2 EUR H, I, I EUR, I2, I2 AUD H, I2 EUR, I2 EUR H, IT, IT AUD H, N2, NT, S, S EUR H, S SGD H, S1 2, S1 2 EUR, S1 EUR H & SA
Global High Yield Portfolio	22. September 1997	A, A EUR, A2, A2 CHF H, A2 EUR, A2 EUR H, A2 HKD, A2 PLN H, A2 SGD, A2 SGD H, AA, AA AUD H, AA CAD H, AA EUR H, AA GBP H, AA HKD, AA NZD H, AA RMB H, AA SGD H, AA ZAR H, AK, AK EUR, AK EUR H, AR EUR H, AT, AT AUD H, AT CAD H, AT EUR, AT EUR H, AT GBP H, AT HKD, AT NZD H, AT RMB H, AT SGD, AT SGD H, B, B2, BA, BA AUD H, BA ZAR H, BT, BT AUD H, BT CAD H, BT EUR H, BT GBP H, BT HKD, BT NZD H, C, C EUR, C2, C2 EUR, C2 EUR H, CK, CK EUR H, CT, EA, EA AUD H, EA ZAR H, I, I EUR, I2, I2 AUD H, I2 CHF H, I2 EUR, I2 EUR H, I2 SGD, I2 SGD H, IA AUD H, IQD, IQD EUR, IT, IT AUD H, IT CAD H, IT EUR H, IT GBP H, IT HKD, IT NZD H, IT RMB H, J, N2, NT, S1, S1 EUR, S1D, SA, SHK, SK, W, W EUR, W2, W2 CHF H, W2 EUR H, WT, WT AUD H, WT CAD H, WT EUR H, WT GBP H & WT RMB H

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

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

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

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

Wertpapiere werden zu ihrem aktuellen Marktwert auf Basis der Marktnotierungen oder, wenn keine Marktnotierungen verfügbar sind oder diese als unzuverlässig gelten, zum „angemessenen Marktwert“ entsprechend den Verfahren

bewertet, die vom und unter der allgemeinen Aufsicht des Verwaltungsrats festgelegt werden. Angemessene Bewertungsverfahren sollen die Schlusskurse der Wertpapiere des Portefeuilles so berichtigen, dass sie den zum Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles als angemessen erachteten Wert jener Wertpapiere widerspiegeln.

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

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

Im Hinblick auf Portefeuille-Wertpapiere, die vorwiegend an US-Börsen gehandelt werden, wird erwartet, dass Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts nur unter sehr eingeschränkten Umständen eingesetzt werden, z. B. wenn eine Börse, an der ein bestimmtes Wertpapier gehandelt wird, frühzeitig geschlossen wird oder wenn der Handel mit einem bestimmten Wertpapier ausgesetzt wird. Es wird jedoch erwartet, dass Verfahren zur Ermittlung des angemessenen Werts im Hinblick auf Wertpapiere, die an Börsen außerhalb der USA oder anderen Märkten gehandelt werden, insbesondere an europäischen und asiatischen Märkten, mit Ausnahme von Indien, regelmäßig eingesetzt werden, da diese Märkte u. a. weit vor dem Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles schließen. Zwischen dem Schließen dieser Märkte und dem jeweiligen Bewertungszeitpunkt des Portefeuilles können bedeutende Ereignisse, darunter umfassende Marktbewegungen, eintreten. Insbesondere können Ereignisse auf dem US-Markt, die an einem Handelstag nach dem Schließen dieser anderen Märkte eintreten, den Wert der Portefeuille-Wertpapiere beeinflussen. Das Japan Strategic Value Portfolio und das Asia Ex-Japan Equity Portfolio verfolgen die Politik, Wertpapiere nur dann zum Marktwert zu bewerten, wenn dies auf Basis der Wertentwicklung der Benchmark und der relativen Aktienkapitalflüsse relevant erscheint.

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

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

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

1.2 Bewertung von Optionsscheinen

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

1.3 Finanzterminkontrakte

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

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

1.4 Devisentermingeschäfte

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

1.5 Gekaufte und verkaufte Optionen

Wenn eine Option gekauft wird, wird ein dem bezahlten Preis entsprechender Betrag als Anlage verbucht und im Folgenden dem aktuellen Marktwert der gekauften Option angepasst. Der Preis, der für den Kauf von Optionen bezahlt wurde, die verfallen, ohne ausgeübt zu werden, wird am Verfallsdatum als realisierter Verlust verbucht. Wenn eine gekaufte Verkaufsoption ausgeübt wird, wird der Optionspreis vom Erlös aus dem Verkauf des zugrunde liegenden Wertpapiers oder der Fremdwährung abgezogen, um festzustellen, ob das jeweilige 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

Fremdwahrung hinzuaddiert, um festzustellen, ob das jeweilige Portefeuille einen Gewinn oder Verlust realisiert hat. Wenn eine verkaufte Verkaufsoption ausgeubt wird, senkt der Optionspreis die Kostenbasis des vom jeweiligen Portefeuille gekauften Wertpapiers oder der Fremdwahrung. Borsennotierte Kauf- und Verkaufsoptionen eines Portefeuilles werden zum letzten Verkaufspreis bewertet. Falls an dem Tag kein Verkauf stattgefunden hat, werden die Wertpapiere zum letzten Rucknahmepreis an dem Tag bewertet.

1.6 Anlagen in anderen Organismen fur gemeinsame Anlagen („OGA“)

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

1.7 Swap-Vereinbarungen

Fur Zwischenzahlungen auf Swap-Kontrakte nehmen die Portefeuilles taglich Ruckstellungen innerhalb der Ertrage und Aufwendungen vor. Swap-Kontrakte werden taglich zum letzten Borsenkurs bewertet, wobei Wertschwankungen in der Zusammensetzung des Fondsvermogens als „Unrealisierte Wertsteigerung/(-minderung) aus Swaps“ und in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veranderung des Fondsvermogens als „anderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ ausgewiesen werden. Bei Falligkeit oder Verkauf eines Swap-Kontrakts wird der Nettobetrag in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veranderung des Fondsvermogens unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingeschaften, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ ausgewiesen. Die bezahlten oder erhaltenen Vorabgebuhren werden in der Zusammensetzung des Fondsvermogens als Kosten oder Erlose ausgewiesen und uber die Laufzeit des Kontrakts linear abgeschrieben. Aufgelaufene, abgeschriebene Vorabgebuhren fur Credit-Default-Swaps sind solange im „Swap-Ertrag“ enthalten, bis die Position verkauft wird, danach werden die abgeschriebenen Vorabgebuhren unter „Realisierte Gewinne und (Verluste) aus Anlagen, Devisentermingontrakten, Swaps, Finanzterminkontrakten, Optionen und Devisen“ verbucht. Schwankungen des Werts von Swap-Kontrakten werden als eine Komponente der „anderung der unrealisierten Gewinne und (Verluste) aus Swaps“ in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veranderung des Fondsvermogens ausgewiesen.

In der Zusammensetzung des Fondsvermogens ausgewiesene „Fur Swap-Kontrakte bezahlte (erhaltene) Vorabgebuhren“ enthalten im Freiverkehr fur Credit-Default-Swaps bezahlte (erhaltene) Gebuhren sowie eine Marge, die noch fur die zentral abgerechneten Credit-Default-Swaps beglichen werden muss.

2. Grundungskosten

Die Grundungskosten aller bestehenden Portefeuilles wurden in fruheren Jahren vollstandig abgeschrieben.

3. Zuteilungsmethode

Die Ertrage und Aufwendungen (mit Ausnahme der klassenspezifischen Verwaltungs- und Vertriebsgebuhren) der „Renten“- und „Misch“-Portefeuilles werden taglich auf Basis einer „gemischten Zuteilungs-Rechnung“ zugewiesen. Diese Zuteilungs-Rechnung basiert auf dem prozentualen Verhaltnis zwischen dem Wert der abgerechneten Anteile einer Anteilklasse mit taglicher Feststellung einer Ausschuttung und dem Wert der umlaufenden Anteile, die entweder auf monatlicher Basis Ausschuttungen ausbezahlen oder keine Ausschuttungen

tagigen. Ertrage und Aufwendungen der „Aktien“-Portefeuilles des Fonds werden taglich auf Basis ihres prozentualen Verhaltnisses nach dem Wert ihrer umlaufenden Anteile zugewiesen. Fur alle Portefeuilles werden die realisierten und unrealisierten Gewinne und Verluste des Fonds taglich auf Basis ihres prozentualen Verhaltnisses nach dem Wert ihrer umlaufenden Anteile zugewiesen. Klassenspezifische Verwaltungs-, Verwaltungsgesellschafts- und Vertriebsgebuhren sowie unrealisierte Gewinne und Verluste aus Devisentermingeschaften, die sich auf die wahrungsabgesicherten 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 Aktivitat der Anteilinhaber und Anforderungen des Kontostandes ggf. den entsprechenden Anteilen der Klasse S zugewiesen.

4. Wahrungsumrechnung

Werte, die in einer anderen Wahrung ausgedruckt sind als der Wahrung, in der das Portefeuille laut Vertragsbedingungen denominiert ist, werden unter Anwendung des Mittelwerts zwischen dem letzten erhaltlichen Kauf- und Verkaufspreis umgerechnet. Transaktionen in Fremdwahrungen werden zu dem am Transaktionsdatum geltenden Wechselkurs in die Wahrung des jeweiligen Portefeuilles umgerechnet.

Die kombinierte Zusammensetzung des Fondsvermogens wird in US-Dollar zu den am Datum der kombinierten Zusammensetzung des Fondsvermogens geltenden Wechselkursen dargestellt, wahrend die kombinierte Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veranderung des Fondsvermogens in US-Dollar zu den durchschnittlichen, wahrend des Geschaftsjahres geltenden Wechselkursen dargestellt wird.

Dem Jahresabschluss wurden folgende Kurse zugrunde gelegt: Kassakurs von 1.1807 und Mittelkurs von 1.1952 fur die Umrechnung von EUR in USD, Kassakurs von 0.0091 und Mittelkurs von 0.0093 fur die Umrechnung von JPY in USD.

Die in der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veranderung des Fondsvermogens ausgewiesene „Anpassung aus Wahrungsumrechnung“ ergibt sich aus den unterschiedlichen Wechselkursen, die zur Umrechnung des kombinierten Nettovermogens zu Beginn des Jahres, der kombinierten Zusammensetzung des Fondsvermogens und der kombinierten Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veranderung des Fondsvermogens verwendet wurden.

5. Anlageertrage und Anlagetransaktionen

Dividendenertrage werden am Tag der Notierung ex Dividende verbucht. Zinsertrage werden tagesgenau verbucht. Die Anlagegewinne und -verluste fur die Portefeuilles werden anhand der durchschnittlichen Kostenbasis festgestellt.

Der Fonds verbucht Disagios und amortisiert Pramien als Wertberichtigungen der Zinsertrage. Anlagegeschafte werden am Transaktionstag zuzuglich eines Tages verbucht.

6. Schatzungen

Bei der Erstellung des Abschlusses im Einklang mit den in Luxemburg allgemein anerkannten Rechnungslegungsgrundsatzen muss die Fondsverwaltung Schatzungen 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 Berichtszeitraums auswirken. Die tatsächlichen Ergebnisse können von diesen Schätzungen abweichen.

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

Die Verwaltungsgesellschaft hat allen Anteilhabern des Fonds mitgeteilt, dass mit Wirkung vom 2. November 2015 eine Richtlinie zur Anpassung des Nettoinventarwerts (NAV) eingeführt wird, die auch als „Swing Pricing“ bekannt ist. Gemäß dieser Richtlinie kann der NAV eines Portefeuilles angepasst werden, um die Auswirkungen der geschätzten Transaktionskosten, Preisabschläge und Gebühren, die durch die Kauf- und Rücknahmeaktivitäten der Anteilhaber entstehen, widerzuspiegeln. Swing Pricing kommt automatisch zur Anwendung, wenn die täglichen Nettozeichnungen oder -rücknahmen einen Schwellenwert überschreiten, der vom Swing-Pricing-Komitee unter Aufsicht des Verwaltungsrats festgelegt wurde. Wenn Swing Pricing zur Anwendung kommt, wird der NAV der Anteile des jeweiligen Portefeuilles um einen Betrag nach oben oder unten korrigiert, der im Allgemeinen höchstens 2% des jeweiligen NAV entspricht, so dass die Transaktionskosten, die aufgrund der Kauf- und Rücknahmeaktivität entstehen, nicht vom Portefeuille selbst, sondern von den Anlegern getragen werden, die mit den Portefeuilleanteilen handeln. Diese Anpassung soll die Verwässerung des Werts der Anteilhaber-Investitionen in Anteile eines Portefeuilles, die durch Transaktionen mit Portefeuilleanteilen hervorgerufen wird, minimieren.

Die jüngsten und beispiellosen Bedingungen an den Finanzmärkten im Zusammenhang mit der COVID-19-Krise führten zu einer Weitung der Geld-Brief-Spannen bei bestimmten Wertpapieren und folglich zu höheren Transaktionskosten für den Fonds. Das Swing-Pricing-Komitee ist der Ansicht, dass die aktuellen allgemeinen Swing-Pricing-Schwellenwerte von bis zu 2% für den Fonds möglicherweise die erwarteten Kosten im Zusammenhang mit den Preisen für die Handelsabwicklung nicht angemessen widerspiegeln und daher die Interessen der Anteilhaber des Fonds im Falle von Rücknahme- und Zeichnungsaktivitäten möglicherweise nicht vollständig schützen. Der Verwaltungsrat hat im Einklang mit den „CSSF-FAQ zum Swing-Pricing-Mechanismus“ beschlossen, dem Swing-Pricing-Komitee die Möglichkeit einzuräumen, über den Schwellenwert für Swing Pricing hinauszugehen, je nachdem, wie es dies für die Portefeuilles für angemessen hält, um sicherzustellen, dass die übrigen Anteilhaber des Fonds nicht von den derzeitigen Transaktionskosten im Zusammenhang mit der COVID-19-Krise in Mitleidenschaft gezogen werden.

Der in den statistischen Angaben offengelegte NAV je Anteil und das Gesamtnettovermögen sind der veröffentlichte NAV 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 Gesamt-NAV ohne Swing-Anpassungen zum Ende eines Berichtszeitraums ist.

Alle Swing Pricing unterliegenden Portefeuilles passten ihren NAV während des Berichtszeitraums an. Zum 31. August 2021 passte keines der Portefeuilles seinen NAV an.

ANMERKUNG C: Steuern

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

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

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

ANMERKUNG D: Ausschüttungen

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

Für das Dynamic Diversified Portfolio:

- Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Ausschüttungen können aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. 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 A, B, C, I, S, S1, SP, S1P, AX, BX, CX und IX (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widerspiegelt.

Für das Global Value Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S, S1, SA GB, SB GB, S1A GB und S1B GB (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widerspiegelt.

- Für Anteile der Klassen AD, BD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. 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 Markets Growth Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, N, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD und ED (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. 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 US Thematic Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, AN, B, C, E, I, IN, S, S1, S1A GB, S1B GB (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen INN und SINN beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, eine jährliche Dividende zu erklären und auszuschütten, die in der Regel sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portfolios entspricht, die diesen Anteilklassen zuzuschreiben sind.
- Für Anteile der Klasse AD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. 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 Asia Ex-Japan Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AY und BY kann die Verwaltungsgesellschaft im eigenen Ermessen auf Grundlage der Nettoerträge, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind, Dividenden erklären und ausschütten.
- Für Anteile der Klassen AD, BD, ED, ID und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. 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 Japan Strategic Value Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S, S1 und 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD, BD und SD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. 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 China Low Volatility Equity Portfolio:

- Für Anteile der Klassen A, B, C, I, S und S1 beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im jeweiligen NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klassen AD und BD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten, daher können die Ausschüttungen aus den Nettoerträgen, aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen

und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. 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 Short Duration Bond Portfolio:

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

Für das Global High Yield Portfolio:

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

Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.

- Für Anteile der Klassen IQD und S1QD beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind. Für Anteile der Klasse SK kann die Verwaltungsgesellschaft nach ihrem Ermessen Dividenden erklären und ausschütten.
- Für Anteile der Klassen AK und CK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, BA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klassen SHK und SQ beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, N2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

Für das American Income Portfolio:

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

- Für Anteile der Klassen AK und CK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
 - Für Anteile der Klassen AA, BA, EA, IA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Für Anteile der Klasse SHK (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, die Ausschüttungen täglich zu erklären und monatlich vorzunehmen. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
 - Für Anteile der Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
 - Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, L2, N2, S, S1 und W2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H und Klasse DUR PH) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für das European Income Portfolio:
- Für Anteile der Klassen A, B, C und I beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
 - Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT, S1D und WT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
 - Für Anteile der Klassen AK und CK beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden zweimal jährlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für das Emerging Markets Debt Portfolio:
- Für Anteile der Klassen A, B, C und I (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden täglich zu erklären und monatlich auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
 - Für Anteile der Klassen AT, BT, CT, IT, NT und ZT (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
 - Für Anteile der Klassen AA, BA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.

- Für Anteile der Klassen AI und EI (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilsklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Ausschüttungen können aus den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen), aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und möglicherweise in erheblichem Umfang aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Ausschüttungen, die die Nettoerträge (Bruttoerträge abzüglich Gebühren und Aufwendungen) übersteigen, könnten eine Rückerstattung des ursprünglich investierten Betrags des Anlegers darstellen und somit den Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klasse reduzieren. Falls der Nettoinventarwert je Anteil unter 1 USD bzw. 1 AUD fällt, wird die Verwaltungsgesellschaft in ihrem alleinigen Ermessen erwägen, entweder (i) die Anteilklasse umzustrukturieren, auch durch die Zusammenlegung mit einer Anteilklasse mit ähnlichen Merkmalen, oder (ii) die Anteilklasse zu liquidieren. Dividenden können auf Wunsch der Anteilinhaber automatisch wiederangelegt werden.
- Für Anteile der Klassen A2, B2, C2, I2, N2, S, S1 und S1 2 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.
- Für Anteile der Klasse S1QD (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt der Verwaltungsrat, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AT, ATX, IT, NT und ZT beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten, wobei diese Dividenden sämtlichen oder im Wesentlichen sämtlichen Nettoerträgen des Portefeuilles entsprechen werden, die der jeweiligen Anteilklasse zuzuweisen sind.
- Für Anteile der Klassen AA, BA, EA und SA (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden monatlich zu erklären und auszuschütten. Die Verwaltungsgesellschaft beabsichtigt, für diese Anteilsklassen eine stabile Ausschüttungsquote je Anteil aufrechtzuerhalten. Für Anteile der Klasse AR (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft, Dividenden jährlich zu erklären und auszuschütten. Die Ausschüttungsquote wird von den Bruttoerträgen (vor Abzug von Gebühren und Aufwendungen) abgeleitet, und die Ausschüttungen können auch aus den realisierten und unrealisierten Gewinnen und aus dem der jeweiligen Klasse zuzuschreibenden Kapital vorgenommen werden. Da die Gebühren und Aufwendungen die Ausschüttungsquote nicht reduzieren, wird der Nettoinventarwert je Anteil der jeweiligen Klassen 1 um diese Gebühren und Aufwendungen reduziert.
- Für Anteile der Klassen A2, A2X, B2X, C2, C2X, I2, I2X, N2 und S1 (und die entsprechenden Anteile der Klasse H) beabsichtigt die Verwaltungsgesellschaft derzeit nicht, Dividenden auf die Anteile auszuschütten. Aus diesem Grunde werden alle Nettoerträge und realisierten Nettogewinne, die diesen Anteilen zuzuschreiben sind, im NAV widergespiegelt.

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

Für das Mortgage Income Portfolio:

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

ANMERKUNG E: Verwaltungsgebühren und andere Transaktionen mit verbundenen Unternehmen

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

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

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

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Dynamic Diversified Portfolio	Klasse A	1.95%
	Klasse A EUR	1.95%
	Klasse A EUR H	1.95%
	Klasse AX	1.90%
	Klasse AX EUR	1.90%
	Klasse AX SGD	1.90%
	Klasse B(a)	2.95%
	Klasse BX	2.90%
	Klasse BX SGD	2.90%
	Klasse C	2.25%
	Klasse C EUR	2.25%
	Klasse C EUR H	2.25%
	Klasse CX	2.20%
	Klasse I	1.25%

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Dynamic Diversified			Sustainable US Thematic		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse I EUR	1.25%	Portfolio (Fortsetzung)	Klasse IN	0.95%
	Klasse I EUR H	1.25%		Klasse IN EUR	0.95%
	Klasse IX	1.20%		Klasse S	0.15%
	Klasse S1 EUR H	0.80%		Klasse S1	0.80%
Global Equity Blend				Klasse S1 EUR	0.80%
Portfolio	Klasse A	2.10%		Klasse S1 JPY H	0.80%
	Klasse A EUR	2.10%	Asia Ex-Japan Equity		
	Klasse A EUR H	2.10%	Portfolio	Klasse A	2.05%
	Klasse A SGD	2.10%		Klasse A AUD H	2.05%
	Klasse B	3.10%		Klasse A EUR	2.05%
	Klasse B SGD	3.10%		Klasse A HKD	2.05%
	Klasse C	2.55%		Klasse A SGD H	2.05%
	Klasse C EUR	2.55%		Klasse AD	2.05%
	Klasse I	1.30%		Klasse AD AUD H	2.05%
	Klasse I EUR	1.30%		Klasse AD CAD H	2.05%
	Klasse S(b)	0.10%		Klasse AD EUR	2.05%
	Klasse S HKD	0.10%		Klasse AD EUR H	2.05%
	Klasse S1	0.80%		Klasse AD GBP H	2.05%
	Klasse S1 EUR	0.80%		Klasse AD HKD	2.05%
	Klasse S1 GBP	0.80%		Klasse AD NZD H	2.05%
	Klasse S1 SGD	0.80%		Klasse AD RMB H	2.05%
Global Value Portfolio	Klasse S	0.12%		Klasse AD SGD H	2.05%
	Klasse S GBP	0.12%		Klasse AD ZAR H	2.05%
	Klasse S GBP H	0.12%		Klasse AY JPY	2.05%
	Klasse S1	0.82%		Klasse BD	3.05%
	Klasse S1 EUR	0.82%		Klasse BD AUD H	3.05%
	Klasse S1 GBP	0.82%		Klasse BD CAD H	3.05%
	Klasse SD	0.12%		Klasse BD GBP H(c)	3.05%
Emerging Markets Growth				Klasse BD HKD	3.05%
Portfolio	Klasse S	0.30%		Klasse BD NZD H	3.05%
	Klasse S1	1.20%		Klasse BD ZAR H	3.05%
	Klasse S1 EUR	1.20%		Klasse BY JPY	2.52%
	Klasse S1 GBP	1.20%		Klasse C	2.50%
Sustainable US Thematic				Klasse C AUD H	2.50%
Portfolio	Klasse A	1.75%		Klasse C EUR	2.50%
	Klasse A AUD H	1.75%		Klasse ED	3.05%
	Klasse A CAD H	1.75%		Klasse I	1.25%
	Klasse A EUR	1.75%		Klasse I AUD H	1.25%
	Klasse A EUR H	1.75%		Klasse I EUR	1.25%
	Klasse A GBP H	1.75%		Klasse I GBP	1.25%
	Klasse A HKD	1.75%		Klasse ID	1.25%
	Klasse A SGD H	1.75%		Klasse ID AUD H	1.25%
	Klasse AN	1.75%		Klasse S	0.30%
	Klasse B	2.75%		Klasse S HKD	0.30%
	Klasse C	2.20%		Klasse S1	1.20%
	Klasse C EUR	2.20%		Klasse S1 EUR	1.20%
	Klasse C EUR H	2.20%		Klasse SD	0.30%
	Klasse C SGD	2.20%	Japan Strategic Value		
	Klasse E	2.75%	Portfolio	Klasse 2(d)	1.35%
	Klasse I	0.95%		Klasse A	2.15%
	Klasse I EUR	0.95%		Klasse A AUD H	2.15%
	Klasse I EUR H	0.95%		Klasse A CZK H	2.15%
	Klasse I GBP	0.95%		Klasse A EUR	2.15%
				Klasse A EUR H	2.15%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Japan Strategic Value		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse A NZD H	2.15%
	Klasse A PLN	2.15%
	Klasse A SGD	2.15%
	Klasse A SGD H	2.15%
	Klasse A USD	2.15%
	Klasse A USD H	2.15%
	Klasse AD	2.15%
	Klasse AD AUD H	2.15%
	Klasse AD NZD H	2.15%
	Klasse AD USD H	2.15%
	Klasse AD ZAR H	2.15%
	Klasse B(b)	3.15%
	Klasse B EUR(e)	3.15%
	Klasse BD(f)	3.15%
	Klasse BD AUD H	3.15%
	Klasse BD USD H(e)	3.15%
	Klasse BD ZAR H(f)	3.15%
	Klasse C	2.60%
	Klasse C EUR	2.60%
	Klasse C EUR H	2.60%
	Klasse C USD	2.60%
	Klasse I	1.35%
	Klasse I EUR	1.35%
	Klasse I EUR H	1.35%
	Klasse I SGD	1.35%
	Klasse I USD	1.35%
	Klasse I USD H	1.35%
	Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse S1(b)	0.80%
	Klasse S1 EUR	0.80%
	Klasse S1 USD	0.80%
	Klasse S1 USD H	0.80%
	Klasse SD	0.15%
China Low Volatility Equity		
Portfolio	Klasse A	1.99%
	Klasse A EUR	1.99%
	Klasse A HKD	1.99%
	Klasse A PLN H	1.99%
	Klasse AD	1.99%
	Klasse AD AUD H	1.99%
	Klasse AD CAD H	1.99%
	Klasse AD EUR H	1.99%
	Klasse AD GBP H	1.99%
	Klasse AD HKD	1.99%
	Klasse AD NZD H	1.99%
	Klasse AD RMB H	1.99%
	Klasse AD SGD H	1.99%
	Klasse AD ZAR H	1.99%
	Klasse B	2.99%
	Klasse B EUR	2.99%
	Klasse BD(g)	2.99%
	Klasse BD AUD H(g)	2.99%
	Klasse BD EUR H(f)	2.99%
	Klasse BD NZD H	2.99%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
China Low Volatility Equity		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse BD ZAR H	2.99%
	Klasse C	2.44%
	Klasse C EUR	2.44%
	Klasse I	1.19%
	Klasse I EUR	1.19%
	Klasse S	0.16%
	Klasse S1	0.91%
	Klasse S1 EUR	0.91%
Short Duration Bond		
Portfolio	Klasse A	1.20%
	Klasse A EUR	1.20%
	Klasse A2	1.20%
	Klasse A2 EUR	1.20%
	Klasse A2 EUR H	1.20%
	Klasse A2 HKD	1.20%
	Klasse A2 SGD H	1.20%
	Klasse AA	1.20%
	Klasse AA AUD H	1.20%
	Klasse AA CAD H	1.20%
	Klasse AA GBP H	1.20%
	Klasse AA HKD	1.20%
	Klasse AA NZD H	1.20%
	Klasse AA SGD H	1.20%
	Klasse AJ	1.00%
	Klasse AR EUR H	1.20%
	Klasse AT	1.20%
	Klasse AT AUD H	1.20%
	Klasse AT CAD H	1.20%
	Klasse AT EUR	1.20%
	Klasse AT EUR H	1.20%
	Klasse AT GBP H	1.20%
	Klasse AT HKD	1.20%
	Klasse AT NZD H	1.20%
	Klasse AT SGD H	1.20%
	Klasse AX	1.00%
	Klasse B	2.20%
	Klasse B2(b)	2.20%
	Klasse B2 EUR	2.20%
	Klasse BA(h)	2.20%
	Klasse BT	2.20%
	Klasse BT AUD H(i)	2.20%
	Klasse BT CAD H(a)	2.20%
	Klasse BT GBP H(i)	2.20%
	Klasse BX(a)	1.00%
	Klasse C	1.60%
	Klasse C2	1.60%
	Klasse C2 EUR H	1.60%
	Klasse I	0.575%
	Klasse I EUR	0.575%
	Klasse I2	0.575%
	Klasse I2 AUD H	0.575%
	Klasse I2 EUR	0.575%
	Klasse I2 EUR H	0.575%
	Klasse IT	0.575%

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

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

AB FCPI-	Anteilklasse	%	AB FCPI-	Anteilklasse	%
Emerging Markets Debt			Emerging Markets Debt		
Portfolio (Fortsetzung)	Klasse AA	1.50%	Portfolio (Fortsetzung)	Klasse IT AUD H	0.95%
	Klasse AA AUD H	1.50%		Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse AA CAD H	1.50%		Klasse IT SGD H	0.95%
	Klasse AA EUR H	1.50%		Klasse N2	2.05%
	Klasse AA GBP H	1.50%		Klasse NT	2.05%
	Klasse AA HKD	1.50%		Klasse S	0.15%
	Klasse AA NZD H	1.50%		Klasse S EUR H	0.15%
	Klasse AA RMB H	1.50%		Klasse S GBP H	0.15%
	Klasse AA SGD H	1.50%		Klasse S1 2	0.70%
	Klasse AA ZAR H	1.50%		Klasse S1 2 EUR	0.70%
	Klasse AI	1.50%		Klasse S1 EUR H	0.70%
	Klasse AI AUD H	1.50%		Klasse S1 GBP H	0.70%
	Klasse AR EUR	1.50%		Klasse S1QD EUR H	0.70%
	Klasse AT	1.50%		Klasse SA	0.15%
	Klasse AT AUD H	1.50%			
	Klasse AT CAD H	1.50%	Mortgage Income Portfolio	Klasse A	1.50%
	Klasse AT EUR	1.50%		Klasse A2	1.50%
	Klasse AT EUR H	1.50%		Klasse A2 EUR	1.50%
	Klasse AT GBP H	1.50%		Klasse A2 HKD	1.50%
	Klasse AT HKD	1.50%		Klasse A2 SGD	1.50%
	Klasse AT NZD H	1.50%		Klasse A2X	1.25%
	Klasse AT RMB H	1.50%		Klasse A2X EUR	1.25%
	Klasse AT SGD H	1.50%		Klasse AA	1.50%
	Klasse B(a)	2.50%		Klasse AA AUD H	1.50%
	Klasse B2(b)	2.50%		Klasse AA HKD	1.50%
	Klasse B2 EUR	2.50%		Klasse AA RMB H	1.50%
	Klasse B2 HKD	2.50%		Klasse AA SGD H	1.50%
	Klasse BA	2.50%		Klasse AA ZAR H	1.50%
	Klasse BA AUD H	2.50%		Klasse AR EUR H	1.50%
	Klasse BA ZAR H	2.50%		Klasse AT	1.50%
	Klasse BT	2.50%		Klasse AT AUD H	1.50%
	Klasse BT AUD H	2.50%		Klasse AT EUR	1.50%
	Klasse BT CAD H(i)	2.50%		Klasse AT GBP H	1.50%
	Klasse BT EUR H	2.50%		Klasse AT HKD	1.50%
	Klasse BT GBP H(i)	2.50%		Klasse AT SGD	1.50%
	Klasse BT HKD	2.50%		Klasse AT SGD H	1.50%
	Klasse BT NZD H(i)	2.50%		Klasse AX	1.25%
	Klasse C	1.95%		Klasse AX EUR	1.25%
	Klasse C EUR	1.95%		Klasse B2X	1.70%
	Klasse C2	1.95%		Klasse BA(n)	2.50%
	Klasse C2 EUR	1.95%		Klasse BA AUD H(h)	2.50%
	Klasse C2 EUR H	1.95%		Klasse BA ZAR H(o)	2.50%
	Klasse CT	1.95%		Klasse BX	1.70%
	Klasse EA	2.00%		Klasse BX EUR	1.70%
	Klasse EA AUD H	2.00%		Klasse C	1.95%
	Klasse EA ZAR H	2.00%		Klasse C2	1.95%
	Klasse EI	2.00%		Klasse C2 EUR	1.95%
	Klasse EI AUD H	2.00%		Klasse C2X	1.70%
	Klasse I	0.95%		Klasse CX	1.70%
	Klasse I2	0.95%		Klasse I	0.95%
	Klasse I2 CHF H	0.95%		Klasse I EUR	0.95%
	Klasse I2 EUR	0.95%		Klasse I2	0.95%
	Klasse I2 EUR H	0.95%		Klasse I2 EUR	0.95%
	Klasse IT(m)	0.95%		Klasse I2 EUR H	0.95%

AB FCPI-	Anteilklasse	%
Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)	Klasse I2X	0.70%
	Klasse IT EUR H	0.95%
	Klasse IX	0.70%
	Klasse N2	2.05%
	Klasse NT	2.05%
	Klasse S	0.15%
	Klasse S1	0.65%
	Klasse S1 EUR	0.65%
	Klasse S1 EUR H	0.65%
	Klasse S1 JPY	0.65%
	Klasse S1X	0.55%
	Klasse SA	0.15%

- (a) Die Anteilklasse wurde am 29. Januar 2021 aufgelöst.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 15. Juli 2021 aufgelöst.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 30. Juli 2021 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 19. Februar 2021 aufgelöst.
- (e) Die Anteilklasse wurde am 20. August 2021 aufgelöst.
- (f) Die Anteilklasse wurde am 21. Juni 2021 aufgelöst.
- (g) Die Anteilklasse wurde am 20. Juli 2021 aufgelöst.
- (h) Die Anteilklasse wurde am 22. März 2021 aufgelöst.
- (i) Die Anteilklasse wurde am 31. März 2021 aufgelöst.
- (j) Die Anteilklasse wurde am 29. Juli 2021 aufgelöst.
- (k) Die Anteilklasse wurde am 15. Juni 2021 aufgelöst.
- (l) Die Anteilklasse wurde am 17. August 2021 aufgelöst.
- (m) Die Anteilklasse wurde am 25. Mai 2021 aufgelöst.
- (n) Die Anteilklasse wurde am 20. April 2021 aufgelöst.
- (o) Die Anteilklasse wurde am 20. Mai 2021 aufgelöst.

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

AB FCPI -	Getragene Aufwendungen	Forderungen aus Aufwandsersatzung
Dynamic Diversified Portfolio . . .	\$ 268,780	92,111
Global Equity Blend Portfolio . . .	\$ 37,376	16,524
Global Value Portfolio	\$ 13	13
Emerging Markets Growth Portfolio	\$ 3	3
Sustainable US Thematic Portfolio	\$ 12,769	12,769
Asia Ex-Japan Equity Portfolio . . .	\$ 22,005	17,872
Japan Strategic Value Portfolio . . .	¥ 19,162,350	7,254,783
China Low Volatility Equity Portfolio	\$ 102,918	58,289
Short Duration Bond Portfolio . . .	\$ 103,870	86,816
American Income Portfolio	\$ 207	39
Emerging Markets Debt Portfolio	\$ -	3,407
Mortgage Income Portfolio	\$ 1,655	18,236

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

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

Der Fonds zahlt der Verwaltungsgesellschaft außerdem eine Verwaltungsgesellschaftsgebühr.

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

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

Die Jahressätze der betreffenden Gebühren für die einzelnen Portefeuilles sind in Tabelle 1 (auf Seite 202 bis 216) aufgeführt.

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

Der Fonds zahlt seiner Registrier- und Transferstelle AllianceBernstein Investor Services, einem Geschäftsbereich der Verwaltungsgesellschaft, eine Vergütung dafür, dass sie Personal und Räumlichkeiten im Rahmen der Erbringung von Dienstleistungen als Registrier- und Transferstelle des Fonds zur Verfügung stellt. Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2021 belief sich dieser Betrag auf \$24,432,925.

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. August 2021 belief sich dieser Betrag auf \$746,182. Der Betrag ist in der Gebühr für professionelle Dienstleistungen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten.

Der Fonds vergütet seinem Rechtsberater Elvinger Hoss Prussen, *société anonyme* (bei dem Yves Prussen, ein Verwaltungsratsmitglied der Verwaltungsgesellschaft, Partner ist) gegenüber dem Fonds erbrachte Rechtsdienste. Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2021 wurde eine Vergütung in Höhe von €116,876 entrichtet, die in der Gebühr für professionelle Dienstleistungen in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens enthalten ist.

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

Alle im Namen des Fonds abgeschlossenen Geschäfte wurden im Verlauf der regulären Geschäftstätigkeit und/oder zu den handelsüblichen Bedingungen getätigt. Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2021 wurden keine Provisionen für Wertpapiertransaktionen unter Beanspruchung der Dienste der Tochtergesellschaften, Sanford C. Bernstein & Co., LLC and Bernstein

Autonomous LLP., gezahlt. Mehrere Verwaltungsratsmitglieder des Fonds sind Mitarbeiter und/oder leitende Angestellte des Anlageverwalters und/oder seiner verbundenen Unternehmen.

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

High Yield Portfolio, das AB SICAV I – Asia Income Opportunities Portfolio, das AB SICAV I – Global Income Portfolio und das AB SICAV I – Short Duration Income Portfolio, die von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Das Emerging Markets Debt Portfolio investiert in das AB SICAV I – Emerging Market Corporate Debt Portfolio, das von der Verwaltungsgesellschaft verwaltet wird.

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

ANMERKUNG F: Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen und Transaktionskosten

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2021 haben der Anlageverwalter und eventuelle verbundene Unteranlageverwalter, soweit nach geltendem Recht zulässig, Ausgleichsprovisionen/-vereinbarungen mit Brokern in Bezug auf Portefeuilles des Fonds erhalten bzw. abgeschlossen, die in Aktienwerten anlegen, für welche bestimmte Güter und Dienstleistungen zur Unterstützung des Anlageentscheidungsprozesses erhalten wurden. Die Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen wurden auf Grundlage der Voraussetzung abgeschlossen, dass die Abwicklung von Transaktionen für den Fonds im Einklang mit den Standards zur bestmöglichen Abwicklung erfolgt und der Anlageverwalter beim Abschluss von Vereinbarungen über Ausgleichsprovisionen zahlreiche Faktoren hinsichtlich der Standards zur bestmöglichen Abwicklung berücksichtigt, wie beispielsweise Umfang und Art der Brokergebühren.

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

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

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

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

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

In der folgenden Tabelle sind die Transaktionskosten, die für die einzelnen Portefeuilles im Geschäftsjahr zum 31. August 2021 angefallen sind, aufgeführt:

AB FCPI-	Transaktionskosten
Dynamic Diversified Portfolio	\$ 23,103
Global Equity Blend Portfolio	\$ 90,349
Global Value Portfolio	\$ 409,275
Emerging Markets Growth Portfolio	\$ 2,133,214
Sustainable US Thematic Portfolio	\$ 66,660
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	\$ 1,217,868
Japan Strategic Value Portfolio	¥ 6,333,897
China Low Volatility Equity Portfolio	\$ 333,330
Short Duration Bond Portfolio	\$ 27,144
Global High Yield Portfolio	\$ 3,244,165
American Income Portfolio	\$ 196,202
European Income Portfolio	€ 29,141
Emerging Markets Debt Portfolio	\$ 3,508
Mortgage Income Portfolio	\$ -0-

ANMERKUNG G: Devisentermingeschäfte

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

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

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

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

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

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

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

Die Wertpapiere im Fonds werden als Sicherheit für Devisenterminkontrakte verwendet.

ANMERKUNG H: Pensionsgeschäfte

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

Zum 31. August 2021 gab es keine Pensionsgeschäfte.

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

ANMERKUNG I: Umgekehrte Pensionsgeschäfte

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

teils zurückzuerlangen und gleichzeitig die Zinserträge, die mit diesen Portefeuille-Wertpapieren verbunden sind, behalten.

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

Zum 31. August 2021 bestanden keine umgekehrten Pensionsgeschäfte.

Während des Geschäftsjahres wurden keine Zinserträge aus umgekehrten Pensionsgeschäften verzeichnet.

ANMERKUNG J: Finanzterminkontrakte

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

Zu dem Zeitpunkt, an dem der Fonds einen Finanzterminkontrakt abschließt, hinterlegt und hält er beim Broker die von der Börse, an der der Kontrakt abgeschlossen wird, 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. Dieser Zahlungsempfang bzw. diese Zahlung wird als Einschusszahlung bezeichnet und vom Fonds als unrealisierter Gewinn bzw. Verlust verbucht. Nach der Glattstellung des Kontrakts weist der Fonds in Höhe des Unterschieds zwischen dem Wert des Kontrakts bei Abschluss und bei der Glattstellung einen realisierten Gewinn bzw. Verlust aus.

ANMERKUNG K: Swap-Geschäfte

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

Zentral abgerechnete Credit-Default-Swaps

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

Zentral abgerechnete Zinsswaps

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

ANMERKUNG L: Optionsgeschäfte

Der Fonds kann Kauf- und Verkaufsoptionen auf Wertpapiere kaufen und verkaufen. Das mit dem Kauf einer Option verbundene Risiko besteht darin, dass der Fonds eine Prämie bezahlt, unabhängig davon, ob die Option ausgeübt wird oder nicht. Außerdem besteht das Risiko, dass der Fonds die Prämie verliert und sich der Marktwert verändert, sollte der Kontrahent seinen vertraglichen Verpflichtungen nicht nachkommen. Gekaufte Kauf- und Verkaufsoptionen werden auf dieselbe Art ausgewiesen wie die Wertpapiere eines Portefeuilles. Die Kosten für die durch Ausübung einer Kaufoption gekauften Wertpapiere erhöhen sich um die gezahlten Prämien. Die Erlöse aus den durch Ausübung einer Verkaufsoption verkauften Wertpapieren verringern sich um die gezahlten Prämien.

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

Für verkaufte Optionen erhaltene Prämien, die auslaufen, ohne ausgeübt zu werden, werden vom Fonds am Verfallstermin als realisierter Gewinn aus verkauften Optionen verbucht. Die Differenz zwischen der erhaltenen Prämie und dem gezahlten Betrag bei Ausführung einer 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.

Total-Return-Swaps

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

Credit-Default-Swaps

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

Zinsswaps

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

Inflationsswap

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

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

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

ANMERKUNG M: Sicherheiten

In der folgenden Tabelle sind die Barsicherheiten aufgeführt, die zum 31. August 2021 für bestimmte derivative Finanzinstrumente vom Broker gehalten wurden bzw. diesem zu entrichten waren:

AB FCPI –	Vom Broker gehaltene Barmittel	Dem Broker zu entrichtende Barmittel
Dynamic Diversified Portfolio		
Credit Suisse	\$ 60,037	66,425
Morgan Stanley	\$ 336,007	68,442
Short Duration Bond Portfolio		
Citibank	\$ 440,058	–
Morgan Stanley	\$ 5,341,072	1,318,985
Global High Yield Portfolio		
Citibank	\$ 29,315,722	1,168,687
Credit Suisse	\$ 47,392,000	–
Goldman Sachs	\$ 53,830,000	–
JPMorgan Chase	\$ 56,474,000	–
Morgan Stanley	\$ 17,158,629	333,702,249
American Income Portfolio		
Barclays	\$ 180,000	–
Citibank	\$ 47,990,000	150,685,018
Credit Suisse	\$ 2,960,000	–
Deutsche Bank	\$ –	6,860,000
Goldman Sachs	\$ 3,310,000	–
JPMorgan Chase	\$ 126,418,000	–
Morgan Stanley	\$ 22,506,395	–
European Income Portfolio		
Goldman Sachs	€ 438,951	5,579,150
Emerging Markets Debt Portfolio		
Morgan Stanley	\$ 4,538,293	–
Mortgage Income Portfolio		
Citibank	\$ 4,106,705	–
Credit Suisse	\$ 1,811,400	–
Goldman Sachs	\$ 727,000	–
JPMorgan Chase	\$ 5,637,000	–
Morgan Stanley	\$ 3,817,356	–

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. August 2021 von den einzelnen Portefeuilles gehaltenen Derivate sind in der folgenden Tabelle aus Wertpapieren bestehende Sicherheiten aufgeführt:

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
Global High Yield Portfolio		
Bank of America		
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 392,457	–

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 2,978,722	–
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 442,495	–
U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 385,156	–
Citibank		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 27,386,965	–
U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 1,203,748	–
U.S. Treasury Notes, 1.13%, 02/15/2031	\$ 1,757,625	–
Credit Suisse		
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 85,023,626	–
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 649,116	–
U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 1,762,259	–
U.S. Treasury Notes, 1.13%, 02/15/2031	\$ 1,083,589	–
Deutsche Bank		
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 986	–
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 485,394	–
U.S. Treasury Bonds, 1.38%, 08/15/2050	\$ 7,716,380	–
Goldman Sachs		
U.S. Treasury Bonds, 6.25%, 05/15/2030	\$ 117,449,449	–
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 2,775,308	–
U.S. Treasury Bonds, 6.63%, 02/15/2027	\$ 55,474,006	–
U.S. Treasury Bonds, 1.38%, 08/15/2050	\$ 9,119,151	–
HSBC Bank		
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 267,644	–
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 407,075	–
Morgan Stanley		
U.S. Treasury Bonds, 6.75%, 08/15/2026	\$ 274,487,182	–
U.S. Treasury Bonds, 7.50%, 11/15/2024	\$ 71,680,781	–
U.S. Treasury Bonds, 7.63%, 02/15/2025	\$ 50,649,516	–
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 262,942,510	–

AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten	AB FCPI –	Marktwert der dem Broker bereitgestellten Sicherheiten	Marktwert der vom Broker erhaltenen Sicherheiten
Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)			Credit Suisse		
U.S. Treasury Bonds, 6.63%, 02/15/2027	\$ 5,318,089	–	U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 54,035,775	–
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 49,969,581	–	U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 737,405	–
U.S. Treasury Bonds, 1.38%, 08/15/2050	\$ 9,741,158	–	Goldman Sachs		
U.S. Treasury Notes, 0.38%, 04/30/2025	\$ 674,941	–	U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 8,471,344	–
U.S. Treasury Notes, 1.13%, 02/15/2031	\$ 1,588,770	–	U.S. Treasury Bonds, 1.13%, 08/15/2040	\$ 164,473,630	–
American Income Portfolio			Morgan Stanley		
Barclays			U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 3,975,638	–
U.S. Treasury Bonds, 6.00%, 02/15/2026	\$ 184,922	–	U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 284,399	–
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 8,848,990	–	U.S. Treasury Bonds, 1.13%, 08/15/2040	\$ 35,448,614	–
Citibank			European Income Portfolio		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 11/15/2027	\$ 476,887,028	–	Bank of America		
U.S. Treasury Bonds, 6.13%, 08/15/2029	\$ 151,335,275	–	U.S. Treasury Bonds, 2.00%, 05/31/2024	\$ –	192,147

ANMERKUNG N: Verleih von Portefeuille-Wertpapieren

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

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

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

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

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

Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2021 erwirtschafteten die Portefeuilles Nettogebühreneinnahmen, die in der Ertrags- und Aufwandsrechnung und Veränderung des Fondsvermögens unter „Erträge aus der Wertpapierleihe, netto“ ausgewiesen sind.

Für das Geschäftsjahr zum 31. August 2021 verdiente Brown Brothers Harriman & Co. (in seiner Funktion als Wertpapierleihstelle) ein Honorar von \$63,673 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. August 2021 verliehenen Wertpapiere und die entsprechenden ausstehenden Sicherheiten haben folgenden Wert. Die Sicherheiten beziehen sich auf die in den Portefeuilles gehaltenen Wertpapiere.

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Equity Blend Portfolio . .		
Societe Generale	\$ 81,362	85,436
Citigroup Global Markets Limited	\$ 73,708	77,416
Merrill Lynch	\$ 46,409	48,835
Credit Suisse	\$ 20,114	21,126

AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten	AB FCPI –	Wert	Marktwert der Sicherheiten
Global Value Portfolio			Japan Strategic Value Portfolio . .		
Merrill Lynch	\$ 643,693	677,338	Citigroup Global Markets Limited	¥ 211,044,435	221,658,575
Emerging Markets Growth Portfolio			Merrill Lynch	¥ 56,155,711	59,090,922
Citigroup Global Markets Limited	\$ 3,864,152	4,058,493	China Low Volatility Equity Portfolio		
JPMorgan Chase	\$ 2,420,549	2,541,703	Citigroup Global Markets Limited	\$ 2,803,530	2,944,529
Sustainable US Thematic Portfolio			UBS AG	\$ 759,889	798,288
Barclays	\$ 4,735,500	4,987,501	Merrill Lynch	\$ 115,014	121,027

ANMERKUNG O: Bankkredite

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

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

ANMERKUNG P: Gemeinsame Verwaltung von Vermögenswerten

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

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

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

Zum 31. August 2021 verwaltet der Fonds die Vermögenswerte bestimmter Portefeuilles innerhalb des Fonds unter Verwendung der folgenden Pools gemeinsam:

Pool an Vermögenswerten

ACM Global Investments-Global Bond Pool
 ACM Bernstein-Global Growth Pool
 ACM Global Investments-Global Value Pool

Beteiligte Portefeuilles

Short Duration Bond Portfolio
 Global Equity Blend Portfolio
 Global Equity Blend Portfolio
 Global Value Portfolio

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR

AB FCPI

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
<u>Dynamic Diversified Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR H	1.70%	0.10%	N/A	1.95%
AX	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
AX EUR	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
AX SGD	1.40%	0.10%	N/A	1.90%
B(a)	1.70%	0.10%	1.00%	2.95%
BX	1.40%	0.10%	1.00%	2.90%
BX SGD	1.40%	0.10%	1.00%	2.90%
C	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR H	1.90%	0.10%	N/A	2.25%
CX	1.70%	0.10%	N/A	2.20%
I	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
I EUR	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
I EUR H	0.90%	0.10%	N/A	1.25%
IX	0.70%	0.10%	N/A	1.20%
S1 EUR H	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
<u>Global Equity Blend Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.60%	0.10%	N/A	1.95%
A EUR	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
A EUR H	1.60%	0.10%	N/A	1.94%
A SGD	1.60%	0.10%	N/A	2.10%
B	1.60%	0.10%	1.00%	2.93%
B SGD	1.60%	0.10%	1.00%	3.10%
C	2.05%	0.10%	N/A	2.40%
C EUR	2.05%	0.10%	N/A	2.55%
I	0.80%	0.10%	N/A	1.14%
I EUR	0.80%	0.10%	N/A	1.30%
S(b)	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S HKD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 EUR	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 GBP	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 SGD	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.80%
<u>Global Value Portfolio</u>				
Klasse				
A	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
A EUR	1.50%	0.10%	N/A	1.97%
A SGD	1.50%	0.10%	N/A	1.97%
A SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
AD AUD H	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
AD CAD H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD EUR H	1.50%	0.10%	N/A	1.80%
AD GBP H	1.50%	0.10%	N/A	1.82%
AD HKD	1.50%	0.10%	N/A	1.99%
AD SGD H	1.50%	0.10%	N/A	1.79%
AD ZAR H	1.50%	0.10%	N/A	1.81%
B	1.50%	0.10%	1.00%	2.78%
BD	1.50%	0.10%	1.00%	2.77%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt-kostenquote*</u>
Global Value Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
BD AUD H(c)	1.50%	0.10%	1.00%	2.76%
BD EUR H(d)	1.50%	0.10%	1.00%	2.76%
BD ZAR H(d)	1.50%	0.10%	1.00%	2.77%
C	1.95%	0.10%	N/A	2.25%
C EUR	1.95%	0.10%	N/A	2.42%
I	0.70%	0.10%	N/A	1.04%
I EUR	0.70%	0.10%	N/A	1.17%
I SGD	0.70%	0.10%	N/A	1.18%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
S GBP	N/A	0.01%(8)	N/A	0.12%
S GBP H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
S1	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.79%
S1 EUR	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.82%
S1 GBP	0.70%	0.01%(8)	N/A	0.82%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%

Emerging Markets Growth Portfolio

Klasse				
A	1.70%	0.10%	N/A	1.99%
A AUD H	1.70%	0.10%	N/A	1.99%
A EUR	1.70%	0.10%	N/A	2.34%
A HKD	1.70%	0.10%	N/A	2.33%
A PLN H	1.70%	0.10%	N/A	2.00%
A SGD	1.70%	0.10%	N/A	2.33%
A SGD H	1.70%	0.10%	N/A	1.98%
AD	1.70%	0.10%	N/A	2.04%
B	1.70%	0.10%	1.00%	2.97%
C	2.15%	0.10%	N/A	2.44%
C AUD H	2.15%	0.10%	N/A	2.44%
C EUR	2.15%	0.10%	N/A	2.78%
ED	1.70%	0.10%	1.00%	2.98%
I	0.90%	0.10%	N/A	1.17%
I AUD H	0.90%	0.10%	N/A	1.21%
I EUR	0.90%	0.10%	N/A	1.54%
N	2.15%	0.10%	N/A	2.43%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.00%
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.20%
S1 GBP	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.20%

Sustainable US Thematic Portfolio

Klasse				
A	1.50%	0.05%	N/A	1.74%
A AUD H	1.50%	0.05%	N/A	1.75%
A CAD H	1.50%	0.05%	N/A	1.72%
A EUR	1.50%	0.05%	N/A	1.75%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	1.72%
A GBP H	1.50%	0.05%	N/A	1.68%
A HKD	1.50%	0.05%	N/A	1.75%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	1.72%
AN	1.50%	0.05%	N/A	1.71%
B	1.50%	0.05%	1.00%	2.71%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.17%
C EUR	1.95%	0.05%	N/A	2.20%
C EUR H	1.95%	0.05%	N/A	2.16%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Sustainable US Thematic Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
C SGD	1.95%	0.05%	N/A	2.20%
E.....	1.50%	0.05%	1.00%	2.75%
I.....	0.70%	0.05%	N/A	0.92%
I EUR.....	0.70%	0.05%	N/A	0.95%
I EUR H.....	0.70%	0.05%	N/A	0.91%
I GBP.....	0.70%	0.05%	N/A	0.95%
IN.....	0.70%	0.05%	N/A	0.92%
IN EUR.....	0.70%	0.05%	N/A	0.95%
S.....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S1.....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.72%
S1 EUR.....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 JPY H.....	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.73%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio				
Klasse				
A.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A AUD H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A EUR.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A HKD.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
A SGD H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD AUD H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD CAD H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD EUR.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD EUR H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD GBP H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD HKD.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD NZD H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AD RMB H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.04%
AD SGD H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.04%
AD ZAR H.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
AY JPY.....	1.70%	0.05%	N/A	2.05%
BD.....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
BD AUD H.....	1.70%	0.05%	1.00%	3.04%
BD CAD H.....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
BD GBPH(e).....	1.70%	0.05%	1.00%	2.93%
BD HKD.....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
BD NZD H.....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
BD ZAR H.....	1.70%	0.05%	1.00%	3.04%
BY JPY.....	1.45%	0.05%	0.72%	2.52%
C.....	2.15%	0.05%	N/A	2.48%
C AUD H.....	2.15%	0.05%	N/A	2.50%
C EUR.....	2.15%	0.05%	N/A	2.50%
ED.....	1.70%	0.05%	1.00%	3.05%
I.....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I AUD H.....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I EUR.....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
I GBP.....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
ID.....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
ID AUD H.....	0.90%	0.05%	N/A	1.25%
S.....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.17%
S HKD.....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.29%
S1.....	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.07%
S1 EUR.....	0.90%	0.01%(8)	N/A	1.16%
SD.....	N/A	0.01%(8)	N/A	0.18%

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Japan Strategic Value Portfolio				
Klasse				
2(f)	1.20%	0.05%	N/A	1.35%
A	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
A AUD H	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
A CZK H	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
A EUR	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
A EUR H	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
A NZD H	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
A PLN	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
A SGD	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
A SGD H	1.50%	0.05%	N/A	2.13%
A USD	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
A USD H	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
AD	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
AD AUD H	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
AD NZD H	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
AD USD H	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
AD ZAR H	1.50%	0.05%	N/A	2.15%
B(b)	1.50%	0.05%	1.00%	3.12%
B EUR(c)	1.50%	0.05%	1.00%	3.15%
BD(g)	1.50%	0.05%	1.00%	3.11%
BD AUD H	1.50%	0.05%	1.00%	3.15%
BD USD H(c)	1.50%	0.05%	1.00%	3.11%
BD ZAR H(g)	1.50%	0.05%	1.00%	3.10%
C	1.95%	0.05%	N/A	2.59%
C EUR	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
C EUR H	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
C USD	1.95%	0.05%	N/A	2.60%
I	0.70%	0.05%	N/A	1.30%
I EUR	0.70%	0.05%	N/A	1.35%
I EUR H	0.70%	0.05%	N/A	1.35%
I SGD	0.70%	0.05%	N/A	1.35%
I USD	0.70%	0.05%	N/A	1.35%
I USD H	0.70%	0.05%	N/A	1.35%
S EUR H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%
S1(b)	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 EUR	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 USD	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
S1 USD H	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.80%
SD	N/A	0.01%(8)	N/A	0.15%

China Low Volatility Equity Portfolio

Klasse				
A	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A EUR	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A HKD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
A PLN H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD AUD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD CAD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD EUR H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD GBP H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD HKD	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD NZD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD RMB H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
China Low Volatility Equity Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AD SGD H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
AD ZAR H	1.70%	0.05%	N/A	1.99%
B	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
B EUR	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD(d)	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD AUD H(d)	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD EUR H(g)	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD NZD H	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
BD ZAR H	1.70%	0.05%	1.00%	2.99%
C	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
C EUR	2.15%	0.05%	N/A	2.44%
I	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
I EUR	0.90%	0.05%	N/A	1.19%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.16%
S1	0.75%	0.01%(8)	N/A	0.91%
S1 EUR	0.75%	0.01%(8)	N/A	0.91%
Short Duration Bond Portfolio				
Klasse				
A	0.85%	0.10%	N/A	1.15%
A EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
A2	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
A2 EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
A2 EUR H	0.85%	0.10%	N/A	1.13%
A2 HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
A2 SGD H	0.85%	0.10%	N/A	1.12%
AA	0.85%	0.10%	N/A	1.12%
AA AUD H	0.85%	0.10%	N/A	1.15%
AA CAD H	0.85%	0.10%	N/A	1.15%
AA GBP H	0.85%	0.10%	N/A	1.15%
AA HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AA NZD H	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AA SGD H	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AJ	0.65%	0.10%	N/A	0.96%
AR EUR H	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AT	0.85%	0.10%	N/A	1.15%
AT AUD H	0.85%	0.10%	N/A	1.15%
AT CAD H	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AT EUR	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT EUR H	0.85%	0.10%	N/A	1.14%
AT GBP H	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AT HKD	0.85%	0.10%	N/A	1.20%
AT NZD H	0.85%	0.10%	N/A	1.17%
AT SGD H	0.85%	0.10%	N/A	1.16%
AX	0.65%	0.10%	N/A	0.97%
B	0.85%	0.10%	1.00%	2.12%
B2(b)	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
B2 EUR	0.85%	0.10%	1.00%	2.20%
BA(h)	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
BT	0.85%	0.10%	1.00%	2.12%
BT AUD H(i)	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
BT CAD H(a)	0.85%	0.10%	1.00%	2.11%
BT GBP H(i)	0.85%	0.10%	1.00%	2.10%
BX(a)	0.65%	0.10%	N/A	0.89%

Short Duration Bond Portfolio (Fortsetzung)

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
C	1.25%	0.10%	N/A	1.55%
C2	1.25%	0.10%	N/A	1.55%
C2 EUR H	1.25%	0.10%	N/A	1.53%
I	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I EUR	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 AUD H	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 EUR	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
I2 EUR H	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
IT	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
IT AUD H	0.325%	0.10%	N/A	0.575%
N2	1.35%	0.10%	N/A	1.66%
NT	1.35%	0.10%	N/A	1.62%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S EUR H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S SGD H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%
S1 2	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
S1 2 EUR	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
S1 EUR H	0.25%	0.01%(8)	N/A	0.35%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.10%

Global High Yield Portfolio**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
A	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
A EUR	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.65%
A2	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
A2 CHF H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
A2 EUR	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.65%
A2 EUR H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
A2 HKD	1.27%(1)	0.10%	N/A	1.65%
A2 PLN H	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.62%
A2 SGD	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.65%
A2 SGD H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.59%
AA AUD H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA CAD H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA EUR H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.59%
AA GBP H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.59%
AA HKD	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.65%
AA NZD H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AA RMB H	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.59%
AA SGD H	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.60%
AA ZAR H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.59%
AK	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.57%
AK EUR	1.27%(1)	0.10%	N/A	1.65%
AK EUR H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AR EUR H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT AUD H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT CAD H	1.35%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT EUR	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.65%
AT EUR H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT GBP H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt- kostenquote*
Global High Yield Portfolio** (Fortsetzung)				
Klasse				
AT HKD	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.65%
AT NZD H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT RMB H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
AT SGD	1.36%(1)	0.10%	N/A	1.65%
AT SGD H	1.37%(1)	0.10%	N/A	1.58%
B	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
B2	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
B2 EUR H(i)	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BA	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BA AUD H	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BA ZAR H	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BT	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BT AUD H	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BT CAD H	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BT EUR H	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
BT GBP H	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
BT HKD	1.36%(1)	0.10%	1.00%	2.65%
BT NZD H	1.37%(1)	0.10%	1.00%	2.57%
C	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.08%
C EUR	1.74%(2)	0.10%	N/A	2.15%
C2	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.09%
C2 EUR	1.86%(2)	0.10%	N/A	2.15%
C2 EUR H	1.85%(2)	0.10%	N/A	2.08%
CK	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.09%
CK EUR H	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.07%
CT	1.87%(2)	0.10%	N/A	2.08%
EA	1.35%(1)	0.10%	0.50%	2.09%
EA AUD H	1.35%(1)	0.10%	0.50%	2.09%
EA ZAR H	1.37%(1)	0.10%	0.50%	2.09%
I	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
I EUR	0.86%(3)	0.10%	N/A	1.15%
I2	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
I2 AUD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
I2 CHF H	0.86%(3)	0.10%	N/A	1.09%
I2 EUR	0.86%(3)	0.10%	N/A	1.15%
I2 EUR H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
I2 SGD	0.81%(3)	0.10%	N/A	1.14%
I2 SGD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IA AUD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IQD	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IQD EUR	0.81%(3)	0.10%	N/A	1.14%
IT	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT AUD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.09%
IT CAD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.07%
IT EUR H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT GBP H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT HKD	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.19%
IT NZD H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
IT RMB H	0.87%(3)	0.10%	N/A	1.08%
J	1.36%(1)	0.10%	1.00%	2.58%
N2	1.93%(4)	0.10%	N/A	2.14%
NT	1.92%(4)	0.10%	N/A	2.14%
S EUR H(j)	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
S1	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.94%

Global High Yield Portfolio (Fortsetzung)**

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
S1 EUR	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.99%
S1D	0.90%	0.01%(8)	N/A	0.94%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SK	0.65%	0.01%(8)	N/A	0.69%
SQ(k)	0.60%	0.01%(8)	N/A	0.63%
W	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.99%
W EUR	0.76%(9)	0.10%	N/A	1.05%
W2	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2 CHF H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
W2 EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	1.01%
WT	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT AUD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.97%
WT CAD H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT EUR H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.98%
WT GBP H	0.75%(9)	0.10%	N/A	0.96%
WT RMB H	0.75%(9)	0.10%	N/A	1.00%

American Income Portfolio

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
A	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A2 CHF H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A2 DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A2 EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2 EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
A2 HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
A2 SGD	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
A2 SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AA	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA CAD H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AA DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AA EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA GBP H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA HKD	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AA NZD H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AA ZAR H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AK	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AK EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AK EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AR EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.30%
AR EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AT	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AT AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AT CAD H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AT DUR PH	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AT EUR	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT EUR H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AT GBP H	1.10%	0.10%	N/A	1.31%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
AT HKD.....	1.10%	0.10%	N/A	1.37%
AT NZD H.....	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AT RMB H.....	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
AT SGD.....	1.10%	0.10%	N/A	1.36%
AT SGD H.....	1.10%	0.10%	N/A	1.31%
B.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
B2.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
B2 HKD.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.07%
BA.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BA AUD H.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BA ZAR H.....	1.10%	0.10%	0.70%	1.99%
BT.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT AUD H.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT CAD H.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT EUR.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BT EUR H.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.01%
BT GBP H.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.00%
BT HKD.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
BT NZD H.....	1.10%	0.10%	0.70%	2.01%
C.....	1.55%	0.10%	N/A	1.76%
C EUR.....	1.55%	0.10%	N/A	1.81%
C2.....	1.55%	0.10%	N/A	1.76%
C2 DUR PH.....	1.55%	0.10%	N/A	1.76%
C2 EUR.....	1.55%	0.10%	N/A	1.82%
C2 EUR H.....	1.55%	0.10%	N/A	1.75%
CT.....	1.55%	0.10%	N/A	1.76%
EA.....	1.10%	0.10%	0.50%	1.81%
EA AUD H.....	1.10%	0.10%	0.50%	1.81%
EA ZAR H.....	1.10%	0.10%	0.50%	1.81%
I.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I EUR.....	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I2 AUD H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I2 CHF H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
I2 DUR PH.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I2 EUR.....	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2 EUR H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
I2 HKD.....	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2 SGD.....	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2 SGD H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.75%
IA.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IA AUD H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT AUD H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT CAD H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT EUR H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT GBP H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT HKD.....	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
IT JPY.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT JPY H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.77%
IT NZD H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%
IT RMB H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.83%
IT SGD.....	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
IT SGD H.....	0.55%	0.10%	N/A	0.76%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt-kostenquote*
American Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
J	1.10%	0.10%	0.70%	2.01%
L2	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
L2 AUD H	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
L2 SGD H	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT AUD H	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
LT SGD H	0.90%	0.10%	N/A	1.05%
N2	1.65%	0.10%	N/A	1.86%
NT	1.65%	0.10%	N/A	1.86%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.53%
S1 EUR	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.58%
S1D	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.54%
S1D2	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.53%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.04%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.03%
W	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
W2	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
W2 CHF H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
W2 EUR H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT AUD H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT EUR H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT GBP H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%
WT HKD	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.66%
WT SGD H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.59%

European Income Portfolio

Klasse				
A	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
A USD	1.10%	0.10%	N/A	1.26%
A2	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
A2 CHF H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
A2 PLN H	1.10%	0.10%	N/A	1.33%
A2 SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.34%
A2 USD	1.10%	0.10%	N/A	1.26%
A2 USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AA	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AA AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AA HKD H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AA RMB H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AA SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AA USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AK	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AR	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AT	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AT AUD H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AT SGD H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
AT USD	1.10%	0.10%	N/A	1.26%
AT USD H	1.10%	0.10%	N/A	1.35%
B(b)	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
B USD	1.10%	0.10%	0.70%	1.96%
B2	1.10%	0.10%	0.70%	2.06%
B2 USD	1.10%	0.10%	0.70%	1.94%
BA	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
European Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
BA AUD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BA USD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BT	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BT AUD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
BT USD	1.10%	0.10%	0.70%	1.96%
BT USD H	1.10%	0.10%	0.70%	2.05%
C	1.55%	0.10%	N/A	1.80%
C USD	1.55%	0.10%	N/A	1.71%
C2	1.55%	0.10%	N/A	1.80%
C2 USD	1.55%	0.10%	N/A	1.71%
C2 USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.80%
CK	1.55%	0.10%	N/A	1.79%
CT USD H	1.55%	0.10%	N/A	1.80%
I	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
I USD	0.55%	0.10%	N/A	0.71%
I2	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
I2 AUD H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
I2 CHF H	0.55%	0.10%	N/A	0.82%
I2 USD	0.55%	0.10%	N/A	0.71%
I2 USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IA	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IA HKD H	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
IA SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IA USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IT	0.55%	0.10%	N/A	0.80%
IT SGD H	0.55%	0.10%	N/A	0.79%
IT USD H	0.55%	0.10%	N/A	0.81%
NT USD H	1.65%	0.10%	N/A	1.90%
S(1)	N/A	0.01%(8)	N/A	0.09%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.58%
S1 USD	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1 USD H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1D	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.58%
SA USD H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.06%
SHK	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
W2	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.64%
W2 CHF H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.64%
W2 USD H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.63%
WA	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.64%
WA HKD H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.63%
WA USD H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.65%
WT	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.63%
WT SGD H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.65%
WT USD H	0.39%(10)	0.10%	N/A	0.60%
Emerging Markets Debt Portfolio				
Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
A EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.42%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
A2 CHF H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.44%
A2 EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.44%

Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)

Klasse	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamt- kostenquote*
A2 PLN	1.10%	0.05%	N/A	1.38%
A2 PLN H	1.10%	0.05%	N/A	1.37%
A2 SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AA CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AA EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.44%
AA NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AA RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.34%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.33%
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AI	1.10%	0.05%	N/A	1.39%
AI AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.41%
AR EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT CAD H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.44%
AT EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.44%
AT NZD H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
AT RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.35%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.36%
B(a)	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
B2(b)	1.10%	0.05%	1.00%	2.35%
B2 EUR	1.10%	0.05%	1.00%	2.44%
B2 HKD	1.10%	0.05%	1.00%	2.44%
BA	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BA AUD H	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BA ZAR H	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT	1.10%	0.05%	1.00%	2.35%
BT AUD H	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT CAD H(i)	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT EUR H	1.10%	0.05%	1.00%	2.32%
BT GBP H(i)	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
BT HKD	1.10%	0.05%	1.00%	2.44%
BT NZD H(i)	1.10%	0.05%	1.00%	2.34%
C	1.55%	0.05%	N/A	1.81%
C EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.88%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.81%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.89%
C2 EUR H	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
CT	1.55%	0.05%	N/A	1.80%
EA	1.10%	0.05%	0.50%	1.86%
EA AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.86%
EA ZAR H	1.10%	0.05%	0.50%	1.86%
EI	1.10%	0.05%	0.50%	1.93%
EI AUD H	1.10%	0.05%	0.50%	1.92%
I	0.55%	0.05%	N/A	0.81%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.80%

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

	<u>Verwaltung</u>	<u>Verwaltungsgesellschaft</u>	<u>Ausschüttung</u>	<u>Gesamt- kostenquote*</u>
Emerging Markets Debt Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I2 CHF H	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.88%
I2 EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.81%
IT(m)	0.55%	0.05%	N/A	0.80%
IT AUD H	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
IT EUR H	0.55%	0.05%	N/A	0.81%
IT SGD H	0.55%	0.05%	N/A	0.78%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.90%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.91%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%
S EUR H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%
S GBP H	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%
S1 2	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.66%
S1 2 EUR	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.66%
S1 EUR H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.62%
S1 GBP H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.61%
S1QD EUR H	0.55%	0.01%(8)	N/A	0.66%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.11%
Mortgage Income Portfolio				
Klasse				
A	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
A2	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
A2 EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.26%
A2 HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.25%
A2 SGD	1.10%	0.05%	N/A	1.22%
A2X	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
A2X EUR	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.21%
AA	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AA HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.26%
AA RMB H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AA ZAR H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AR EUR H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT AUD H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT EUR	1.10%	0.05%	N/A	1.26%
AT GBP H	1.10%	0.05%	N/A	1.31%
AT HKD	1.10%	0.05%	N/A	1.27%
AT SGD	1.10%	0.05%	N/A	1.22%
AT SGD H	1.10%	0.05%	N/A	1.32%
AX	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.25%
AX EUR	1.05%(5)	0.05%	N/A	1.21%
B2X	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.70%
BA(n)	1.10%	0.05%	1.00%	2.30%
BA AUD H(h)	1.10%	0.05%	1.00%	2.33%
BA ZAR H(o)	1.10%	0.05%	1.00%	2.31%
BX	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.70%
BX EUR	1.05%(5)	0.05%	0.45%	1.65%
C	1.55%	0.05%	N/A	1.77%
C2	1.55%	0.05%	N/A	1.76%
C2 EUR	1.55%	0.05%	N/A	1.69%
C2X	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%
CX	1.50%(6)	0.05%	N/A	1.70%

	Verwaltung	Verwaltungsgesellschaft	Ausschüttung	Gesamtkostenquote*
Mortgage Income Portfolio (Fortsetzung)				
Klasse				
I	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.71%
I2	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2 EUR	0.55%	0.05%	N/A	0.71%
I2 EUR H.	0.55%	0.05%	N/A	0.77%
I2X	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
IT EUR H.	0.55%	0.05%	N/A	0.76%
IX	0.50%(7)	0.05%	N/A	0.70%
N2	1.65%	0.05%	N/A	1.86%
NT	1.65%	0.05%	N/A	1.87%
S	N/A	0.01%(8)	N/A	0.08%
S1	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.56%
S1 EUR	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.51%
S1 EUR H	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.57%
S1 JPY	0.50%	0.01%(8)	N/A	0.58%
S1X	0.40%	0.01%(8)	N/A	0.43%
SA	N/A	0.01%(8)	N/A	0.07%

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

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

- (a) Die Anteilklasse wurde am 29. Januar 2021 aufgelöst.
- (b) Die Anteilklasse wurde am 15. Juli 2021 aufgelöst.
- (c) Die Anteilklasse wurde am 20. August 2021 aufgelöst.
- (d) Die Anteilklasse wurde am 20. Juli 2021 aufgelöst.
- (e) Die Anteilklasse wurde am 30. Juli 2021 aufgelöst.
- (f) Die Anteilklasse wurde am 19. Februar 2021 aufgelöst.
- (g) Die Anteilklasse wurde am 21. Juni 2021 aufgelöst.
- (h) Die Anteilklasse wurde am 22. März 2021 aufgelöst.
- (i) Die Anteilklasse wurde am 31. März 2021 aufgelöst.
- (j) Die Anteilklasse wurde am 29. Juli 2021 aufgelöst.
- (k) Die Anteilklasse wurde am 15. Juni 2021 aufgelöst.
- (l) Die Anteilklasse wurde am 17. August 2021 aufgelöst.
- (m) Die Anteilklasse wurde am 25. Mai 2021 aufgelöst.
- (n) Die Anteilklasse wurde am 20. April 2021 aufgelöst.
- (o) Die Anteilklasse wurde am 20. Mai 2021 aufgelöst.

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

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

TABELLE 1
GEBÜHRENSTRUKTUR (Fortsetzung)

AB FCPI

-
- (6) 1.50% bis zu \$100,000,000, 1.45% für die nächsten \$100,000,000 und 1.40% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.
- (7) 0.50% bis zu \$100,000,000, 0.45% für die nächsten \$100,000,000 und 0.40% bei über \$200,000,000. Die aufeinander folgenden Gebührenstufen beziehen sich auf das Nettovermögen des Portefeuilles.

Gebühr der Verwaltungsgesellschaft

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

Maximale Verwaltungsgebühr gemäß den Angaben im Prospekt des Fonds

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

TABELLE 2
PORTEFEUILLEUMSATZ

	<u>Umsatz*</u>
<u>AB FCP I-</u>	
Dynamic Diversified Portfolio	144.98%
Global Equity Blend Portfolio	-31.28%
Global Value Portfolio	-34.36%
Emerging Markets Growth Portfolio	95.02%
Sustainable US Thematic Portfolio	-83.76%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	-5.96%
Japan Strategic Value Portfolio	-77.92%
China Low Volatility Equity Portfolio	-9.07%
Short Duration Bond Portfolio	74.45%
Global High Yield Portfolio	-14.78%
American Income Portfolio	-50.34%
European Income Portfolio	-42.87%
Emerging Markets Debt Portfolio	62.73%
Mortgage Income Portfolio	46.37%

* Ungeprüft.

An die Anteilhaber von AB FCP I

Bestätigungsvermerk

Wir haben den Jahresabschluss von AB FCP I (der „Fonds“) und der einzelnen Portefeuilles geprüft, der aus der Zusammensetzung des Fondsvermögens und dem Verzeichnis der Anlagewerte zum 31. August 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. August 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 im Rahmen des Gesetzes vom 23. Juli 2016 und der ISAs, die von der CSSF für Luxemburg übernommen wurden, sind im Abschnitt „Pflichten des „réviseur d'entreprises agréé“ in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses“ in unserem Bericht näher beschrieben. Wir sind zudem gemäß dem vom International Ethics Standards Board for Accountants („IESBA-Kodex“) herausgegebenen International Code of Ethics for Professional Accountants, einschließlich der International Independence Standards, in der von der CSSF für Luxemburg angenommenen Form sowie den für unsere Prüfung des Abschlusses relevanten ethischen Anforderungen von dem Fonds unabhängig und haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß diesen ethischen Anforderungen erfüllt. Nach unserer Auffassung sind die erhaltenen Prüfungsnachweise als Grundlage für die Erteilung unseres Bestätigungsvermerks ausreichend und angemessen.

Sonstige Informationen

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft 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 und wir geben keinerlei Art von Prüfungsurteil hinsichtlich der Zuverlässigkeit der sonstigen Informationen 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 aufgrund 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 der Verwaltungsgesellschaft in Bezug auf den Abschluss

Der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft ist für die Erstellung und faire Darstellung dieses Jahresabschlusses gemäß den in Luxemburg geltenden rechtlichen und aufsichtsbehördlichen Anforderungen hinsichtlich der Erstellung und Darstellung von Jahresabschlüssen sowie für die internen Kontrollen verantwortlich, die der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft als notwendig erachtet, um die Erstellung von Jahresabschlüssen zu ermöglichen, die frei von wesentlichen falschen Darstellungen sind, unabhängig davon, ob diese auf dolosen Handlungen oder auf Irrtümern basieren.

Bei der Erstellung des Abschlusses ist der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft verantwortlich für die Beurteilung des Fonds und aller seiner Portefeuilles zur Fortsetzung des Geschäftsbetriebs. Dabei muss er Angelegenheiten, die sich auf die Fortsetzung des Geschäftsbetriebs und die Verwendung des Grundsatzes der Unternehmensfortführung beziehen, gegebenenfalls offenlegen, es sei denn, der Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft 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“ in Bezug auf die Prüfung des Abschlusses

Unsere Ziele sind 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.

- 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.
- Beurteilung der Angemessenheit der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft vorgenommenen Schätzungen und der damit im Zusammenhang stehenden Offenlegungen.
- Schlussfolgerung, ob der vom Verwaltungsrat der Verwaltungsgesellschaft 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 des 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.

- 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 für die Überwachung Verantwortlichen, 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.

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

Ernst & Young
Société Anonyme
Cabinet de révision agréé

Kerry Nichol
Luxemburg, 2. Dezember 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. August 2021 hat der Anlageverwalter die Anlageverwaltungsdienstleistungen für die nachstehend aufgeführten Portefeuilles an die folgenden verbundenen Unteranlageverwalter übertragen:

Alliance Bernstein Australia Limited:

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

AllianceBernstein Limited:

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

AllianceBernstein Hong Kong Limited:

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

AllianceBernstein (Singapore) Ltd.:

- Emerging Markets Growth Portfolio

AllianceBernstein (Japan) Ltd.:

- Japan Strategic Value Portfolio

Finanzinformationen zum Fonds

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

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

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

Anteile der Klassen SB GB und S1B GB stehen nur solchen britischen institutionellen Anlegern zur Verfügung, die zur Zufriedenheit der Verwaltungsgesellschaft nachweisen können, dass sie gemäß den relevanten Steuerabkommen zwischen

dem Land des Steuerwohnsitzes des Anlegers und den USA Anspruch auf einen reduzierten Quellensteuersatz von 15% haben, und die sich bereit erklären, der Verwaltungsgesellschaft bestimmte andere Bestätigungen und Informationen zukommen zu lassen, soweit dies erforderlich ist, um nachzuweisen, dass sie zur Anlage in diese Anteile berechtigt sind.

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

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

UniCredit Bank Austria AG
Rothschildplatz 1
1020 Wien
Österreich

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

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

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

ODDO BHF Aktiengesellschaft
Bockenheimer Landstraße 10
60323 Frankfurt am Main
Deutschland

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

BNP Paribas Securities Services SA, 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

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

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

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

Proservice Finteco Spółka z o.o.
(Ehemals Moventum Spółka z o.o.)
21 Cybernetyki Str.
Warschau, Polen

BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich, wurde von der Eidgenössischen Finanzmarktaufsicht FINMA als Schweizer Vertreter des Fonds zugelassen und fungiert außerdem als Zahlstelle. Der Prospekt, die Dokumente mit wesentlichen Anlegerinformationen (KIIDs), die Verwaltungsbestimmungen, die Jahres- und Halbjahresberichte sowie die Aufstellung der Käufe und Verkäufe, die der Fonds im Laufe des Geschäftsjahres getätigt hat, sind auf einfache Anfrage kostenlos beim Schweizer Vertreter, BNP Paribas Securities Services, Paris, succursale de Zurich Selnaustrasse 16, CH-8002 Zurich, Schweiz erhältlich.

Das Dokument mit wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) des Fonds steht 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 Änderungen des Anlageportefeuilles 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.

Für die Rentenportefeuilles hat der Anlageverwalter das Gesamtrisiko (Marktrisiko) unter Verwendung des auf absoluter

Basis errechneten VaR überwacht (nach dem der VaR des betreffenden Portefeuilles 20% seines NAV 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
Dynamic Diversified Portfolio	5.45%	20.55%	13.52%
Short Duration Bond Portfolio	0.23%	1.81%	0.81%
Global High Yield Portfolio	2.09%	14.03%	7.30%
American Income Portfolio	1.38%	9.19%	4.91%
European Income Portfolio	1.30%	12.63%	5.58%
Emerging Markets Debt Portfolio	3.75%	18.77%	10.27%
Mortgage Income Portfolio	0.54%	3.25%	1.79%

Der VaR der einzelnen Portefeuilles und der VaR der Vergleichsgrößen wurden auf Grundlage eines „historischen“ Modells mit einem Vertrauensniveau von 99% und einem

Beobachtungszeitraum von einem Monat oder 20 Tagen errechnet.

Fremdfinanzierung

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

Das erwartete Fremdfinanzierungsniveau wird als Summe der Nominalbeträge der derivativen Finanzinstrumente berechnet, die vom Portefeuille gehalten werden. Laut CSSF-Rundschreiben 11/512 vom 30. Mai 2011 berücksichtigt diese Berechnungsmethode weder die Tatsache, dass ein bestimmtes derivatives Finanzinstrument das Anlagerisiko des Portefeuilles erhöht oder senkt, noch erlaubt sie es, derivative Finanzinstrumente mit umgekehrten Positionen zu verrechnen. Anleger sollten sich dessen bewusst sein, dass (i) ein höheres erwartetes Fremdfinanzierungsniveau nicht automatisch ein höheres Anlagerisiko impliziert und (ii) dass das oben angegebene erwartete Fremdfinanzierungsniveau überwiegend die Verwendung von Derivaten zu Absicherungszwecken oder zum effizienten Portefeuillemanagement widerspiegelt. Darüber hinaus kann das tatsächliche Fremdfinanzierungsniveau des Portefeuilles von dem nachstehend genannten erwarteten Fremdfinanzierungsniveau abweichen:

- Dynamic Diversified Portfolio
0%-300% des NAV des Portefeuilles
- Short Duration Bond Portfolio
0%-150% des NAV des Portefeuilles
- Global High Yield Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- American Income Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- European Income Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- Emerging Markets Debt Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles
- Mortgage Income Portfolio
0%-100% des NAV des Portefeuilles

Vergütung

Vom 1. Januar 2020 bis zum 31. Dezember 2020 (der „Referenzzeitraum“) belief sich der Gesamtbetrag der Vergütung, die – in Barmitteln und/oder beschränkt handelbaren Wertpapieren – von AllianceBernstein (Luxembourg) S.à r.l. (die „Gesellschaft“) an ihre gesamte Belegschaft (die während des Referenzzeitraums im Durchschnitt aus 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 identifizierten Mitarbeiter des Anlageverwalters gezahlt.

Im Referenzzeitraum belief sich der Gesamtbetrag der Vergütung, die an die identifizierte Belegschaft gezahlt wurde, die

Infolge der Verwendung des Summe-der-Nominalbeträge-Ansatzes beträgt die durchschnittliche Fremdfinanzierung der Portefeuilles für das Geschäftsjahr zum 31. August 2021:

Portefeuille	Fremdfinanzierung
Dynamic Diversified Portfolio	82.22%
Short Duration Bond Portfolio	120.15%
Global High Yield Portfolio	50.66%
American Income Portfolio	74.78%
European Income Portfolio	48.33%
Emerging Markets Debt Portfolio	30.20%
Mortgage Income Portfolio	12.46%

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 NAV des Portefeuilles weitgehend entsprechen.

Infolge der Verwendung des Commitment-Ansatzes beträgt die durchschnittliche Fremdfinanzierung der Portefeuilles für das Geschäftsjahr zum 31. August 2021:

Portefeuille	Fremdfinanzierung
Global Equity Blend Portfolio	26.03%
Global Value Portfolio	11.88%
Emerging Markets Growth Portfolio	1.26%
Sustainable US Thematic Portfolio	0.00%
Asia Ex-Japan Equity Portfolio	1.24%
Japan Strategic Value Portfolio	0.00%
China Low Volatility Equity Portfolio ...	0.01%

während des Referenzzeitraums aus 9 Mitarbeitern bestand, auf EUR 1,430,963.25 (wie folgt aufgeteilt: feste Vergütung EUR 1,108,931.46 und variable Vergütung EUR 322,031.79 was weniger als 23% der Gesamtvergütung entspricht).

Die oben genannten identifizierten Mitarbeiter setzen sich aus folgenden Kategorien von Mitarbeitern zusammen: a) Geschäftsleitung (während des Berichtszeitraums drei), b) Mitarbeiter der Verwaltungsgesellschaft, deren Handlungen einen wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der Verwaltungsgesellschaft haben können oder unter die Vergütungsstufe der Geschäftsleitung fallen und die Risiken eingehen (während des Berichtszeitraums vier), und c) 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.

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.

Zum 31. August 2021 war der Fonds in Wertpapierleihgeschäften engagiert und hielt Total-Return-Swaps (TRS), die als Transaktionstyp unter die SFT-Verordnung fallen.

Allgemeine Angaben

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

Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$221,593	0.16%	0.27%

Global Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$643,693	0.07%	0.11%

Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$6,284,701	0.85%	1.17%

Sustainable US Thematic Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$4,735,500	0.48%	0.86%

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	¥267,200,146	3.15%	3.32%

China Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV	% der verleihbaren Anlagen
Wertpapierleihe	\$3,678,433	2.39%	2.86%

Dynamic Diversified Portfolio

Art der Anlage	Betrag	% des NAV
Total-Return-Swaps	\$62,855	0.14%

Angaben zur Wiederverwendung von Sicherheiten

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2021 wurden keine Sicherheiten wiederverwendet.

Im Geschäftsjahr zum 31. August 2021 wurden keine Barsicherheiten wiederangelegt.

Angaben zur Konzentration

Zum 31. August 2021 waren Folgende die zehn größten Emittenten der bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte erhaltenen Wertpapiersicherheiten:

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$ 74,762
2	US-Regierung	\$ 68,867
3	Niederländische Regierung	\$ 37,963
4	Deutsche Regierung	\$ 34,381
5	Schweizer Regierung	\$ 9,402
6	Britische Regierung	\$ 7,438

Global Value Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Deutsche Regierung	\$ 330,362
2	Französische Regierung	\$ 121,919
3	Niederländische Regierung	\$ 121,898
4	Britische Regierung	\$ 103,159

Emerging Markets Growth Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$ 2,190,119
2	Niederländische Regierung	\$ 1,998,737
3	US-Regierung	\$ 1,918,459
4	Schweizer Regierung	\$ 492,881

Sustainable US Thematic Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$ 4,396,406
2	Niederländische Regierung	\$ 591,095

Japan Strategic Value Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Niederländische Regierung	¥ 85,680,931
2	US-Regierung	¥ 79,794,578
3	Französische Regierung	¥ 50,534,483
4	Deutsche Regierung	¥ 28,820,748
5	Schweizer Regierung	¥ 26,919,167
6	Britische Regierung	¥ 8,999,590

China Low Volatility Equity Portfolio

Nr.	Sicherheitsemittenten	Betrag
1	Französische Regierung	\$ 1,062,731
2	US-Regierung	\$ 1,059,997
3	Niederländische Regierung	\$ 1,018,705
4	Schweizer Regierung	\$ 357,596
5	Deutsche Regierung	\$ 346,383
6	Britische Regierung	\$ 18,432

Total-Return-Swaps

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

Zum 31. August 2021 waren Folgende die zehn größten Gegenparteien bezüglich sämtlicher Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps:

Global Equity Blend Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Societe Generale	\$ 81,362
	2	Citigroup Global Markets Limited	\$ 73,708
	3	Merrill Lynch	\$ 46,409
	4	Credit Suisse	\$ 20,114

Global Value Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Merrill Lynch	\$ 643,693

Emerging Markets Growth Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	\$ 3,864,152
	2	JPMorgan Chase	\$ 2,420,549

Sustainable US Thematic Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Barclays	\$ 4,735,500

Japan Strategic Value Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	¥ 211,044,435
	2	Merrill Lynch	¥ 56,155,711

China Low Volatility Equity Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Wertpapierleihe	1	Citigroup Global Markets Limited	\$ 2,803,530
	2	UBS AG	\$ 759,889
	3	Merrill Lynch	\$ 115,014

Dynamic Diversified Portfolio

Art der Anlage	Nr.	Gegenpartei	Betrag
Total-Return-Swaps	1	Morgan Stanley	\$ 47,916
	2	UBS AG	\$ 8,058
	3	JPMorgan Chase	\$ 6,881

Verwahrung der erhaltenen Sicherheiten

Wertpapierleihe

Zum 31. August 2021 wurden die erhaltenen Sicherheiten bei drei Depotbanken gehalten:

Global Equity Blend Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 177,884
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 54,929

Global Value Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 677,338

Emerging Markets Growth Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 5,412,255
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 1,187,941

Sustainable US Thematic Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 4,987,501

Japan Strategic Value Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	¥240,852,871
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	¥ 39,896,626

China Low Volatility Equity Portfolio

Depotbank	Art der Sicherheit	Betrag
Euroclear	Wertpapiersicherheit	\$ 2,535,564
Clearstream	Wertpapiersicherheit	\$ 798,290
Federal Reserve	Wertpapiersicherheit	\$ 529,990

Total-Return-Swaps

Zum 31. August 2021 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps erhalten.

Verwahrung der gewährten Sicherheiten

Total-Return-Swaps

Zum 31. August 2021 wurden keine Wertpapier- und Barsicherheiten für Total-Return-Swaps gewährt.

Erträge/Kosten

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

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 4,657	80%
Für dritte Partei	\$ 1,164	20%

Global Value Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 28,499	80%
Für dritte Partei	\$ 7,125	20%

Emerging Markets Growth Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 195,374	80%
Für dritte Partei	\$ 48,844	20%

Sustainable US Thematic Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 11,453	80%
Für dritte Partei	\$ 2,863	20%

Asia Ex-Japan Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 3,013	80%
Für dritte Partei	\$ 753	20%

Japan Strategic Value Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	¥ 432,648	80%
Für dritte Partei	¥ 108,162	20%

China Low Volatility Equity Portfolio

Erträge	Betrag	% der Gesamterträge
Für den Fonds	\$ 7,671	80%
Für dritte Partei	\$ 1,918	20%

*Total-Return-Swaps***Dynamic Diversified Portfolio**

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 1,182,043	100%

Kosten*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 353,907	100%

Global High Yield Portfolio

Erträge*	Betrag	% der Gesamterträge**
Für den Fonds	\$ 7,509,149	100%

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

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

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

Zusammenfassende Transaktionsangaben

Zum 31. August 2021 besitzen die verschiedenen Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Returns-Swaps folgende Fälligkeiten:

*Wertpapierleihe***Global Equity Blend Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$221,593

Global Value Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$643,693

Emerging Markets Growth Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$6,284,701

Sustainable US 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
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$4,735,500

Japan Strategic Value Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	¥0
Ein Tag bis eine Woche	¥0
Eine Woche bis ein Monat	¥0
Ein bis drei Monate	¥0
Drei Monate bis ein Jahr	¥0
Mehr als ein Jahr	¥0
Offene Laufzeit	¥267,200,146

China Low Volatility Equity Portfolio

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$0
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$0
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$3,678,433

*Total-Return-Swaps***Dynamic Diversified Portfolio**

Fälligkeit	Betrag
Weniger als ein Tag	\$0
Ein Tag bis eine Woche	\$0
Eine Woche bis ein Monat	\$55,974
Ein bis drei Monate	\$0
Drei Monate bis ein Jahr	\$6,881
Mehr als ein Jahr	\$0
Offene Laufzeit	\$0

Zum 31. August 2021 kommen folgende Abrechnungs- und Clearing-Mechanismen für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total-Return-Swaps zum Einsatz:

*Wertpapierleihe***Global Equity Blend Portfolio**

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$221,593

Global Value Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$643,693

Emerging Markets Growth Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$6,284,701

Sustainable US Thematic Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$4,735,500

Japan Strategic Value Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	¥267,200,146

China Low Volatility Equity Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Tri-party	\$3,678,433

Total-Return-Swaps

Dynamic Diversified Portfolio

Abrechnungs- und Clearing-Mechanismus	Betrag
Bilateral	\$62,855

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

Wertpapierleihe

Global Equity Blend Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	\$15,377	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 2.10%, 07/25/2023	\$15,376	AA	>1 Jahr	€	Frankreich
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$13,935	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2025	\$13,935	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.88%, 07/31/2022	\$13,934	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2031	\$13,933	AAA	>1 Jahr	€	USA
Societe Generale	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$13,685	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Frankreich
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 1.13%, 02/15/2031	\$13,674	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 1.88%, 01/31/2022	\$13,669	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	Frankreich
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$12,277	AAA	>1 Jahr	€	USA
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 2.13%, 05/31/2026	\$10,356	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$9,402	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	\$8,790	AA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/13/2023	\$8,790	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 1.75%, 07/15/2023	\$8,789	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2024	\$8,788	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2023	\$7,438	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.25%, 02/15/2029	\$6,240	AAA	>1 Jahr	€	USA
Credit Suisse	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 02/15/2030	\$3,802	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Französische Staatsanleihe 0.25%, 11/25/2026	\$3,801	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Deutsche Staatsanleihe 0.10%, 04/15/2026	\$3,798	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2030	\$3,798	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 0.13%, 10/15/2023	\$3,293	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
Credit Suisse	Niederländische Staatsanleihe 0.75%, 07/15/2027	\$2,964	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Deutsche Staatsanleihe 0.50%, 02/15/2026	\$2,958	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Credit Suisse	Deutsche Staatsanleihe 0.25%, 02/15/2029	\$5	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 0.50%, 03/15/2023	\$4	AA+	>1 Jahr	\$	Frankreich
Societe Generale	US-amerikanische Schatzanweisung 0.00%, 12/02/2021	\$2	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	Frankreich

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Global Value Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	\$121,919	AA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/13/2023	\$121,914	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 1.75%, 07/15/2023	\$121,898	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2024	\$121,898	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2023	\$103,159	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.25%, 02/15/2029	\$86,550	AAA	>1 Jahr	€	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Emerging Markets Growth Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$730,524	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2025	\$730,517	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.88%, 07/31/2022	\$730,494	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2031	\$730,462	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$643,615	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$492,881	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.75%, 11/25/2028	\$457,506	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 3.25%, 10/25/2021	\$457,500	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	USA
JPMorgan Chase	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2025	\$457,448	AA+	>1 Jahr	\$	USA
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2031	\$456,560	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 1.00%, 11/25/2025	\$305,045	AA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 0.00%, 05/25/2022	\$237,033	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Niederländische Staatsanleihe 0.25%, 07/15/2029	\$168,100	AAA	>1 Jahr	€	USA
JPMorgan Chase	Französische Staatsanleihe 2.75%, 10/25/2027	\$2,511	AA	>1 Jahr	€	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Sustainable US Thematic Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Barclays	Französische Staatsanleihe 2.25%, 10/25/2022	\$897,742	AA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$897,736	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 1.75%, 05/25/2023	\$897,661	AA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 4.25%, 10/25/2023	\$897,129	AA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Französische Staatsanleihe 0.00%, 11/25/2030	\$806,138	AA	>1 Jahr	€	Großbritannien
Barclays	Niederländische Staatsanleihe 5.50%, 01/15/2028	\$591,095	AAA	>1 Jahr	€	Großbritannien

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

Japan Strategic Value Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	¥39,898,268	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2025	¥39,897,953	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.88%, 07/31/2022	¥39,896,625	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2031	¥39,894,880	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	¥35,151,682	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	¥26,919,167	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	¥10,636,215	AA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/13/2023	¥10,635,779	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2024	¥10,634,397	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 1.75%, 07/15/2023	¥10,634,369	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2023	¥8,999,590	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.25%, 02/15/2029	¥7,550,572	AAA	>1 Jahr	€	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

China Low Volatility Equity Portfolio

Gegenpartei	Art der Sicherheit	Betrag	Qualität*	Laufzeit der Sicherheit	Währung der Sicherheit	Sitzland der Gegenpartei
Citigroup Global Markets Limited	Französische Staatsanleihe 3.00%, 04/25/2022	\$530,012	AA	3 Monate bis 1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 2.25%, 11/15/2025	\$530,007	AA+	>1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	US-amerikanische Schatzanweisung 1.88%, 07/31/2022	\$529,990	AA+	3 Monate bis 1 Jahr	\$	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2031	\$529,966	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Niederländische Staatsanleihe 0.00%, 07/15/2030	\$466,958	AAA	>1 Jahr	€	USA
Citigroup Global Markets Limited	Schwedische Staatsanleihe 0.75%, 05/12/2028	\$357,596	AAA	>1 Jahr	SEK	USA
UBS AG	Frankreich Treasury Bill 0.00%, 10/06/2021	\$143,692	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.75%, 05/25/2028	\$143,692	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 01/04/2030	\$143,691	AAA	>1 Jahr	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 3.25%, 10/25/2021	\$143,691	AA	1 Monat bis 3 Monate	€	Schweiz
UBS AG	Deutsche Staatsanleihe 2.25%, 09/04/2021	\$143,662	AAA	Weniger als ein Monat	€	Schweiz
UBS AG	Französische Staatsanleihe 0.25%, 11/25/2026	\$79,860	AA	>1 Jahr	€	Schweiz
Merrill Lynch	Französische Staatsanleihe 0.00%, 03/25/2025	\$21,784	AA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.00%, 10/13/2023	\$21,784	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Niederländische Staatsanleihe 1.75%, 07/15/2023	\$21,781	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 6.25%, 01/04/2024	\$21,781	AAA	>1 Jahr	€	USA
Merrill Lynch	Britische Staatsanleihe (Gilt) 0.13%, 01/31/2023	\$18,432	AA	>1 Jahr	£	USA
Merrill Lynch	Deutsche Staatsanleihe 0.25%, 02/15/2029	\$15,465	AAA	>1 Jahr	€	USA

* Bonitätsbewertung langfristiger Emissionen durch Standard and Poor's.

VERWALTUNGSGESELLSCHAFT

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

**VERWALTUNGSRAT DER
 VERWALTUNGSGESELLSCHAFT**

Silvio Cruz
Yves Prussen
Bertrand Reimmel
Steven Eisenberg
Mark Manley

ANLAGEVERWALTER*

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

VERWALTUNGSSTELLE* UND VERWAHRSTELLE

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

REGISTER- UND TRANSFERSTELLE

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

VERTRIEBSSTELLE

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

UNABHÄNGIGER WIRTSCHAFTSPRÜFER

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

RECHTSBERATER

In Luxemburg

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

In den Vereinigten Staaten

Dechert LLP
 One International Place
 40th Floor
 100 Oliver Street
 Boston, MA 02110
 Vereinigte Staaten von Amerika

* Von der Verwaltungsgesellschaft delegiert.

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)

(Diese Seite wurde absichtlich frei gelassen.)



ALLIANCEBERNSTEIN®

ABI-SRA-SW-DA-0821