# NN (L)

## Société d'Investissement à Capital Variable

R.C.S. Luxembourg N° B 44 873

## Jahresbericht und geprüfte Finanzabschlüsse

**LUXEMBOURG** **für das Geschäftsjahr zum 30. September 2021**

NN investment partners

Weitere Informationen sind erhältlich bei:

NN Investment Partners B.V.
P.O. Box 90470
Schenkkade 65
2509 LL The Hague
The Netherlands
E-mail: **info@nnip.com**
oder **www.nnip.com**

# Hinweis

Es wird darauf hingewiesen, dass für die Teilfonds NN (L) Belgian Government Bond, NN (L) Euro Short Duration, NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity, NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity, NN (L) Multi Asset High Income, NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity, keine Anzeige zum Vertrieb der Anteile in der Bundesrepublik Deutschland gemäß § 310 Kapitalanlagegesetzbuch erstattet wurde. Daher dürfen Anteile dieser Teilfonds in der Bundesrepublik Deutschland nicht vertrieben werden.

Es können keine Zeichnungen lediglich auf der Basis der Finanzabschlüsse entgegengenommen werden. Eine Zeichnung ist nur gültig, wenn sie auf der Grundlage des aktuellen Prospekts in Verbindung mit dem letzten Jahresbericht und dem aktuellsten Halbjahresbericht (falls nach dem letzten Jahresbericht veröffentlicht) vorgenommen wurde.

Der Prospekt, die Satzung sowie die Jahres- und Halbjahresberichte werden den Anteilsinhabern bei der Verwahrstelle und am Sitz der Gesellschaft sowie bei den in diesem Bericht genannten lokalen Vertriebsstellen oder Hauptansprechpartnern in der Kundenbetreuung zur Verfügung gestellt. Darüber hinaus werden sie auf Anfrage kostenlos versandt.

Die Angaben in diesem Bericht dienen lediglich der Information. Sie stellen keine Indikatoren für zukünftige Ergebnisse dar.

Der Abschlussprüfer (réviseur d'entreprises agréé) hat lediglich die englischsprachige Version dieses Jahresberichts geprüft. Dementsprechend bezieht sich der Prüfbericht nur auf die englischsprachige Version des Berichts; andere Versionen sind Ergebnis gewissenhafter Übersetzung. Im Falle von Abweichungen zwischen der englischsprachigen Version und der Übersetzung ist die englischsprachige Version maßgeblich.

# Inhaltsverzeichnis

Seite

Organisation 18
Bericht des Verwaltungsrats 24
Bericht des unabhängigen Abschlussprüfers 39
Konsolidierte Abschlüsse
Konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens zum 30.09.2021 42
Konsolidierte Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 42
NN (L) AAA ABS
Statistische Angaben 43
Finanzabschlüsse 44
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 44
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 44
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 45
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 46
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 46
NN (L) Alternative Beta
Statistische Angaben 47
Finanzabschlüsse 49
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 49
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 49
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 50
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 50
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 51
NN (L) Asia Income
Statistische Angaben 52
Finanzabschlüsse 54
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 54
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 54
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 55
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 55
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 56
NN (L) Asian Debt (Hard Currency)
Statistische Angaben 57
Finanzabschlüsse 62
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 62
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 62
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 63

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 65
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 66

NN (L) Asian High Yield
Statistische Angaben 67
Finanzabschlüsse 70
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 70
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 70
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 71
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 73
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 73

NN (L) Banking & Insurance
Statistische Angaben 74
Finanzabschlüsse 76
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 76
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 76
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 77
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 78
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 78

NN (L) Belgian Government Bond
Statistische Angaben 79
Finanzabschlüsse 80
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 80
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 80
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 81
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 81

NN (L) Climate & Environment
Statistische Angaben 82
Finanzabschlüsse 84
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 84
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 84
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 85
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 85
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 86

NN (L) Commodity Enhanced
Statistische Angaben 87
Finanzabschlüsse 89

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 89
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 89
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 90
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 90
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 90

NN (L) Corporate Green Bond

Statistische Angaben 91
Finanzabschlüsse 92
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 92
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 92
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 93
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 95
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 95

NN (L) Emerging Europe Equity

Statistische Angaben 96
Finanzabschlüsse 97
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 97
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 97
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 98
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 98

NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

Statistische Angaben 99
Finanzabschlüsse 100
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 100
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 100
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 101
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 103
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 104

NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

Statistische Angaben 105
Finanzabschlüsse 112
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 112
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 112
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 113
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 120
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 121

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)
Statistische Angaben 122
Finanzabschlüsse 124
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 124
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 124
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 125
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 127
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 128
NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)
Statistische Angaben 129
Finanzabschlüsse 131
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 131
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 131
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 132
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 132
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 133
NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)
Statistische Angaben 134
Finanzabschlüsse 135
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 135
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 135
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 136
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 139
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 139
NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity
Statistische Angaben 140
Finanzabschlüsse 142
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 142
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 142
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 143
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 148
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 149
NN (L) Emerging Markets High Dividend
Statistische Angaben 150
Finanzabschlüsse 153
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 153

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 153
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 154
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 156
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 156

NN (L) Energy
Statistische Angaben 157
Finanzabschlüsse 159
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 159
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 159
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 160
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 160
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 161

NN (L) Euro Covered Bond
Statistische Angaben 162
Finanzabschlüsse 163
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 163
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 163
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 164
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 165
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 165

NN (L) Euro Credit
Statistische Angaben 166
Finanzabschlüsse 168
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 168
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 168
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 169
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 175
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 175

NN (L) EURO Equity
Statistische Angaben 176
Finanzabschlüsse 177
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 177
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 177
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 178
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 178
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 179

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

NN (L) Euro Fixed Income
- Statistische Angaben 180
- Finanzabschlüsse 182
  - Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 182
  - Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 182
  - Wertpapierbestand zum 30.09.2021 183
  - Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 191
  - Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 191

NN (L) Euro High Dividend
- Statistische Angaben 192
- Finanzabschlüsse 196
  - Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 196
  - Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 196
  - Wertpapierbestand zum 30.09.2021 197
  - Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 197
  - Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 198

NN (L) Euro Income
- Statistische Angaben 199
- Finanzabschlüsse 200
  - Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 200
  - Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 200
  - Wertpapierbestand zum 30.09.2021 201
  - Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 202
  - Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 202

NN (L) Euro Liquidity
- Statistische Angaben 203
- Finanzabschlüsse 204
  - Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 204
  - Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 204
  - Wertpapierbestand zum 30.09.2021 205
  - Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 205

NN (L) Euro Long Duration Bond
- Statistische Angaben 206
- Finanzabschlüsse 207
  - Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 207
  - Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 207

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Wertpapierbestand zum 30.09.2021 208
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 211
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 212

NN (L) Euro Short Duration

Statistische Angaben 213
Finanzabschlüsse 214
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 214
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 214
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 215
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 215
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 216

NN (L) Euro Sustainable Credit

Statistische Angaben 217
Finanzabschlüsse 218
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 218
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 218
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 219
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 224
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 224

NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

Statistische Angaben 225
Finanzabschlüsse 227
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 227
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 227
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 228
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 231
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 231

NN (L) Euromix Bond

Statistische Angaben 232
Finanzabschlüsse 233
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 233
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 233
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 234
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 234
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 234

NN (L) European ABS

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Statistische Angaben 235
Finanzabschlüsse 236
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 236
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 236
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 237
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 238
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 238

NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity
Statistische Angaben 239
Finanzabschlüsse 240
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 240
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 240
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 241
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 243
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 243

NN (L) European Equity
Statistische Angaben 244
Finanzabschlüsse 246
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 246
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 246
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 247
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 248
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 248

NN (L) European High Dividend
Statistische Angaben 249
Finanzabschlüsse 251
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 251
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 251
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 252
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 252
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 253

NN (L) European High Yield
Statistische Angaben 254
Finanzabschlüsse 256
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 256
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 256

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Wertpapierbestand zum 30.09.2021 257
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 259
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 260

NN (L) European Participation Equity

Statistische Angaben 261
Finanzabschlüsse 262
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 262
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 262
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 263
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 264

NN (L) European Real Estate

Statistische Angaben 265
Finanzabschlüsse 267
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 267
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 267
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 268
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 268
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 269

NN (L) European Sustainable Equity

Statistische Angaben 270
Finanzabschlüsse 272
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 272
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 272
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 273
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 273
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 274

NN (L) First Class Multi Asset

Statistische Angaben 275
Finanzabschlüsse 279
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 279
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 279
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 280
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 290
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 290

NN (L) First Class Multi Asset Premium

Statistische Angaben 291

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Finanzabschlüsse 292
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 292
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 292
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 293
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 300
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 301

NN (L) First Class Protection
Statistische Angaben 302
Finanzabschlüsse 303
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 303
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 303
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 304
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 304
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 304

NN (L) First Class Stable Yield Opportunities
Statistische Angaben 305
Finanzabschlüsse 307
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 307
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 307
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 308
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 311
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 311

NN (L) First Class Yield Opportunities
Statistische Angaben 312
Finanzabschlüsse 316
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 316
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 316
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 317
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 325
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 326

NN (L) Food & Beverages
Statistische Angaben 327
Finanzabschlüsse 330
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 330
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 330
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 331

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 332
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 332

NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

Statistische Angaben 333
Finanzabschlüsse 336
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 336
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 336
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 337
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 340
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 341

NN (L) Global Bond Opportunities

Statistische Angaben 342
Finanzabschlüsse 345
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 345
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 345
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 346
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 347
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 349

NN (L) Global Convertible Bond

Statistische Angaben 350
Finanzabschlüsse 351
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 351
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 351
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 352
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 353
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 354

NN (L) Global Convertible Opportunities

Statistische Angaben 355
Finanzabschlüsse 357
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 357
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 357
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 358
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 358
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 359

NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

Statistische Angaben 360

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Finanzabschlüsse 361
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 361
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 361
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 362
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 370
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 370

NN (L) Global Equity Impact Opportunities
Statistische Angaben 371
Finanzabschlüsse 373
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 373
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 373
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 374
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 374
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 375

NN (L) Global High Dividend
Statistische Angaben 376
Finanzabschlüsse 380
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 380
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 380
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 381
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 382
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 382

NN (L) Global High Yield
Statistische Angaben 383
Finanzabschlüsse 388
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 388
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 388
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 389
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 394
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 395

NN (L) Global Inflation Linked Bond
Statistische Angaben 396
Finanzabschlüsse 397
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 397
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 397
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 398

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 399
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 400

NN (L) Global Investment Grade Credit
Statistische Angaben 401
Finanzabschlüsse 402
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 402
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 402
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 403
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 404
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 405

NN (L) Global Real Estate
Statistische Angaben 406
Finanzabschlüsse 408
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 408
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 408
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 409
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 410

NN (L) Global Sustainable Equity
Statistische Angaben 411
Finanzabschlüsse 413
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 413
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 413
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 414
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 415
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 415

NN (L) Greater China Equity
Statistische Angaben 416
Finanzabschlüsse 418
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 418
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 418
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 419
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 419

NN (L) Green Bond
Statistische Angaben 420
Finanzabschlüsse 422
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 422

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 422
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 423
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 425
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 426

NN (L) Green Bond Short Duration

Statistische Angaben 427
Finanzabschlüsse 428
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 428
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 428
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 429
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 431
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 431

NN (L) Health Care

Statistische Angaben 432
Finanzabschlüsse 434
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 434
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 434
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 435
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 436
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 436

NN (L) Health & Well-being

Statistische Angaben 437
Finanzabschlüsse 439
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 439
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 439
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 440
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 440

NN (L) Japan Equity

Statistische Angaben 441
Finanzabschlüsse 443
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 443
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 443
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 444
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 445
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 445

NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Statistische Angaben 446
Finanzabschlüsse 448
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 448
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 448
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 449
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 449
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 450

NN (L) Multi Asset High Income
Statistische Angaben 451
Finanzabschlüsse 452
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 452
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 452
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 453
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 453
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 454

NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity
Statistische Angaben 455
Finanzabschlüsse 456
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 456
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 456
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 457
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 460
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 460

NN (L) Smart Connectivity
Statistische Angaben 461
Finanzabschlüsse 463
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 463
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 463
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 464
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 464
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 465

NN (L) Sovereign Green Bond
Statistische Angaben 466
Finanzabschlüsse 467
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 467

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für den Zeitraum vom 01.04.2021 bis 30.09.2021 467
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 468
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 469
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 469

NN (L) US Behavioural Equity
Statistische Angaben 470
Finanzabschlüsse 471
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 471
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für den Zeitraum vom 11.05.2021 bis 30.09.2021 471
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 472
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 473

NN (L) US Credit
Statistische Angaben 474
Finanzabschlüsse 478
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 478
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 478
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 479
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 485
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 485

NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity
Statistische Angaben 486
Finanzabschlüsse 488
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 488
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 488
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 489
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 490
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 490

NN (L) US Factor Credit
Statistische Angaben 491
Finanzabschlüsse 492
Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 492
Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 492
Wertpapierbestand zum 30.09.2021 493
Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 495
Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 495

# Inhaltsverzeichnis (Fortsetzung)

Seite

NN (L) US Growth Equity
- Statistische Angaben 496
- Finanzabschlüsse 497
  - Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für den Zeitraum vom 01.10.2020 bis 22.09.2021 497

NN (L) US High Dividend
- Statistische Angaben 498
- Finanzabschlüsse 502
  - Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 502
  - Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 502
  - Wertpapierbestand zum 30.09.2021 503
  - Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 503
  - Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 504

NN (L) US High Yield
- Statistische Angaben 505
- Finanzabschlüsse 506
  - Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021 506
  - Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 506
  - Wertpapierbestand zum 30.09.2021 507
  - Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 509
  - Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick 510

Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen 511

Weitere Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft) 554

# Organisation

| | |
|---|---|
| **Sitz der Gesellschaft** | 80, route d'Esch, L-1470 Luxembourg |
| **Verwaltungsrat** | |
| **Vorsitzender** | **Dirk Buggenhout**,<br>Head of Investment Operations,<br>NN Investment Partners B.V. (die „Gruppe") |
| **Mitglieder des Verwaltungsrats** | **Benoît De Belder,**<br>Independent Director<br><br>**Patrick Den Besten,**<br>Head of Financial Risk,<br>NN Investment Partners B.V. (die „Gruppe")<br><br>**Jan Jaap Hazenberg,**<br>Head of Product Strategy,<br>NN Investment Partners B.V. (die „Gruppe")<br><br>**Sophie Mosnier,**<br>Independent Director |
| **Verwaltungsgesellschaft** | **NN Investment Partners B.V.,**<br>65, Schenkkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands |
| **Anlageverwalter** | **NN Investment Partners B.V.,**<br>65, Schenkkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands<br><br>(Weiter) delegiert an<br><br>**American Century Investment Management Inc,**<br>4500, Main Street, Kansas City, Missouri, MO 64141-6786,<br>United States<br><br>**Irish Life Investment Managers Limited,**<br>Beresford Court, Beresford Place Dublin 1, Ireland<br><br>**NN Investment Partners North America LLC,**<br>230, Park Avenue, Suite 1800, New York, NY 10169, United States<br><br>**NN Investment Partners Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A.,**<br>12, Topiel, Warsaw 00-342, Poland |

# Organisation (Fortsetzung)

| | |
|---|---|
| | **NN Investment Partners (Singapore) Ltd,**<br>MBFC Tower 2 #31-01, 10 Marina Boulevard, 018983 Singapore |
| | **NNIP Advisors B.V.,**<br>65, Schenkkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands |
| | **Nomura Asset Management Co., Ltd,**<br>2-2-1, Toyosu, Koto-ku, Tokyo 135-0061, Japan |
| | **Nomura Asset Management Taiwan Ltd,**<br>30F, 7 Xin Yi Road, Section 5, Taipei 101, Taiwan, R.O.C. |
| | **Voya Investment Management Co. LLC,**<br>230, Park Avenue, 14th Floor, New York, NY 10169, United States |
| **Depotbank** | **Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.,**<br>80, route d'Esch, L-1470 Luxembourg |
| **Wertpapierleihstelle** | **Goldman Sachs International Bank,**<br>Peterborough Court, 133 Fleet Street, London EC4A2BB, United Kingdom |
| **Hedging-Stelle** | **State Street Bank Europe Limited,**<br>20, Churchill Place, Canary Wharf, London E14 5HJ, United Kingdom |
| **Verwaltungsstelle, Register-, Transfer- und Zahlstelle** | **NN Investment Partners B.V.,**<br>65, Schenkkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands<br><br>delegiert an<br><br>**Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.,**<br>80, route d'Esch, L-1470 Luxembourg |
| **Cabinet de révision agréé** | **KPMG Luxembourg, Société coopérative,**<br>39, Avenue John F. Kennedy, L-1855 Luxembourg |
| **Lokale Vertriebsstellen oder Hauptansprechpartner in der Kundenbetreuung** | |
| Alle anderen Länder | **NN Investment Partners B.V.,**<br>65, Schenkkade, 2595 AS, The Hague, The Netherlands |

# Organisation (Fortsetzung)

| | |
|---|---|
| Asien mit Ausnahme Taiwans | **NN Investment Partners Singapore Ltd,**<br>10 Marina Boulevard #31-01, Marina Bay Financial Centre, 018983 Singapore |
| Belgien | **NN Investment Partners Belgium,**<br>Marnixlaan 23, 1000 Brussels, Belgium |
| Tschechische Republik/Slowakei | **NN Investment Partners C.R., a.s,**<br>Bozděchova 344/2, 150 00 Prague 5, Czech Republic |
| Frankreich | **NN Investment Partners B.V. French Branch,**<br>52-56, rue de la Victoire, 75009 Paris, France |
| Deutschland | **NN Investment Partners B.V. Germany Branch,**<br>Westhafenplatz 1, 60327 Frankfurt am Main, Germany |
| Griechenland | **3K Investment Partners M.F.M.C. S.A. (Business Contributor),**<br>25-27-29 Karneadou Str. GR 106 75, Athens, Greece |
| Italien/Österreich | **NN Investment Partners B.V. Italian Branch,**<br>Via Santa Maria Segreta 7/9, 20123 Milan, Italy |
| Japan | **NN Investment Partners (Japan) Co., Ltd,**<br>44F Shibuya Scramble Square, 2-24-12 Shibuya, Shibuya-ku, Tokyo, 150-6144 Japan |
| Rumänien | **NN Investment Partners B.V. Romania Branch,**<br>Str. Costache Negri Nr. 1-5 Opera Center I, Bucuresti 050552, Romania |
| Spanien/Portugal | **NN Investment Partners B.V. Spanish Branch,**<br>Pº de la Castellana 141, 19th floor, 28046 Madrid, Spain |
| Schweiz* | **NN Investment Partners Switzerland Ltd,**<br>(Schweizer Repräsentanz),<br>Schneckenmannstrasse 25, 8044 Zurich, Switzerland<br><br>**State Street Bank International GmbH,**<br>Munich, Zurich branch, Beethovenstrasse 19, 8002 Zurich, Switzerland |
| Taiwan | **Nomura Asset Management Taiwan Ltd** (Master Agent),<br>30th Floor, No 7, Sec 5 Xinyi Road, Taipei 110 Taiwan, Republic of China |

*Nicht alle in diesem Bericht erwähnten Teilfonds von NN (L) sind zum Vertrieb an nicht-qualifizierte Anleger in der Schweiz zugelassen. Bitte lesen Sie die Schweizer Version dieses Berichts, um sich über den Registrierungsstatus für die Schweiz zu informieren. Die Schweizer Version des Berichts kann kostenlos von der Schweizer Repräsentanz bezogen werden.

# Organisation (Fortsetzung)

| | |
|---|---|
| Vereinigtes Königreich | **NN Investment Partners UK Branch,**<br>25, Old Broad Street, London EC2N 1HQ, United Kingdom |
| **Gegenparteien bei außerbörslichen derivativen Finanzinstrumenten**<br>***Gegenparteien bei Swaps*** | **Barclays Bank Ireland PLC,**<br>One Molesworth Street, Dublin 2, D02 RF29, Ireland |
| | **Barclays Bank PLC,**<br>1 Churchill Place, London E14 5HP, United Kingdom |
| | **BNP Paribas SA,**<br>16 Boulevard Des Italiens, 75009, Paris 9, France |
| | **BofA Securities Europe SA,**<br>51 Rue la Boétie, Paris 8, 75008, France |
| | **Citigroup Global Markets Europe AG,**<br>Reuterweg 16, 60323 Frankfurt am Main, Germany |
| | **Citigroup Global Markets Limited,**<br>25 Canada Square, London, E14 5LB, United Kingdom |
| | **Deutsche Bank AG,**<br>Taunusanlage 12, 60262 Frankfurt, Germany |
| | **Goldman Sachs Bank Europe SE,**<br>Taunusanlage 9-10, 60262 Frankfurt, Germany |
| | **Goldman Sachs International Ltd,**<br>Plumtree Court, 25 Shoe Lane, EC4A 4AU, London, United Kingdom |
| | **HSBC Continental Europe,**<br>38, avenue Kléber, 75116 Paris, France |
| | **J.P. Morgan AG,**<br>Taunustor 1, 60310 Frankfurt, Germany |

# Organisation (Fortsetzung)

***Gegenparteien bei Devisentermingeschäften***

**J.P. Morgan Securities Ltd,**
25 Bank Street, London E14 5JP, United Kingdom

**Morgan Stanley Europe SE,**
Große Gallusstraße 18, 60312 Frankfurt, Germany

**NN Re (Netherlands) NV,**
Prinses Beatrixlaan 35-37, 2595 AK, The Hague, The Netherlands

**Nomura Financial Products Europe GmbH,**
Rathenauplatz 1, 60313 Frankfurt am Main, Germany

**Société Générale,**
29, Boulevard Haussmann, 75009 Paris, France

**UBS AG,**
100 Liverpool Street, London EC2M 2RH, United Kingdom

**Barclays Bank Ireland PLC,**
One Molesworth Street, Dublin 2, D02 RF29, Ireland

**BNP Paribas SA,**
16 Boulevard Des Italiens, 75009, Paris 9, France

**BofA Securities Europe SA,**
51 Rue la Boétie, Paris 8, 75008, France

**Brown Brothers Harriman & Co.,**
50 Post Office Square, Boston, MA 02110-1548, United States

**Citigroup Global Markets Europe AG,**
Reuterweg 16, 60323 Frankfurt am Main, Germany

**Deutsche Bank AG,**
Taunusanlage 12, 60262 Frankfurt, Germany

**Goldman Sachs Bank Europe SE,**
Taunusanlage 9-10, 60262 Frankfurt, Germany

# Organisation (Fortsetzung)

| | |
|---|---|
| | **HSBC Continental Europe,**<br>38, avenue Kléber, 75116 Paris, France |
| | **J.P. Morgan AG,**<br>Taunustor 1, 60310 Frankfurt, Germany |
| | **Morgan Stanley Europe SE,**<br>Große Gallusstraße 18, 60312 Frankfurt, Germany |
| | **Société Générale,**<br>29, Boulevard Haussmann, 75009 Paris, France |
| | **State Street Bank and Trust Co.,**<br>One Lincoln Street, Boston MA 02111-2900, United States |
| | **UBS AG,**<br>100 Liverpool Street, London EC2M 2RH, United Kingdom |
| ***Gegenparteien bei Optionen*** | **BNP Paribas SA,**<br>16 Boulevard Des Italiens, 75009, Paris 9, France |
| | **BofA Securities Europe SA,**<br>51 Rue la Boétie, Paris 8, 75008, France |
| | **Goldman Sachs Bank Europe SE,**<br>Taunusanlage 9-10, 60262 Frankfurt, Germany |
| | **J.P. Morgan AG,**<br>Taunustor 1, 60310 Frankfurt, Germany |

# Bericht des Verwaltungsrats

**Wirtschaftliches Umfeld**

Im vierten Quartal 2020 war die Wirtschaftsentwicklung rund um den Globus weiterhin von der Covid-19-Pandemie geprägt. Die Infektionszahlen zogen wieder an und zwangen die staatlichen Stellen, neue Lockdown-Maßnahmen zu ergreifen. Die Nachfrage blieb in den USA auf Erholungskurs und stabilisierte sich in der Eurozone. Das Wachstum der Konsumgüterausgaben präsentierte sich recht stabil, vor allem weil die Verbraucher ihren Dienstleistungskonsum in andere Bahnen lenkten. In den USA und Europa litten die Unternehmensinvestitionen unter der Unsicherheit über eine zweite Infektionswelle. Etwaige Wachstumseinbußen infolge von Zweitrundeneffekten über den Finanzsektor oder die Arbeitslosigkeit wurden durch Unterstützungsmaßnahmen abgefedert.

Zwei Faktoren spielten für die Finanzmärkte im vierten Quartal eine entscheidende Rolle: die positive Reaktion auf die Wahl des Demokraten Joe Biden zum US-Präsidenten und die besser als erwartet ausgefallenen Wirksamkeitsdaten mehrerer Impfstoffkandidaten. Die Covid-19-Infektionszahlen stiegen im November zwar weiter an, doch die Anleger beschlossen, über die zweite Infektionswelle hinwegzusehen und sich auf eine mögliche Rückkehr zur Normalität zu konzentrieren.

Die Entscheidungsträger waren weiter bestrebt, den wirtschaftlichen Schaden der neuerlichen Lockdowns zu begrenzen. Die Geld- und die Fiskalpolitik bleiben entgegenkommend. Allerdings hängt in den USA viel davon ab, ob die neue Regierung unter US-Präsident Biden die erforderlichen fiskalischen Stimuli durchsetzen kann. Die europäischen Staats- und Regierungschefs unternahmen mit der endgültigen Verabschiedung des neuen siebenjährigen EU-Haushalts sowie des EUR 750 Mrd. schweren Wiederaufbaufonds einen wichtigen Schritt. Die meisten nationalen Regierungen setzten ihre bestehenden Corona-Hilfsmaßnahmen fort, um einem Anstieg der Insolvenzen und Arbeitslosigkeit nach den jüngsten Mobilitätsbeschränkungen entgegenzuwirken.

Eine Woche vor Ablauf der Frist am 31. Dezember verständigten sich das Vereinigte Königreich und die EU auf ein Handels- und Kooperationsabkommen für die Zeit nach dem Brexit. Die beiden Parteien erzielten bei den offenen Schlüsselfragen der Gewährleistung gleicher Wettbewerbsbedingungen, Beilegung von Streitigkeiten und Aufteilung der Fischereirechte einen Kompromiss. Nordirland bleibt Mitglied des EU-Binnenmarkts für den Warenverkehr und wird an seinen Häfen weiterhin die EU-Zollvorschriften durchsetzen. Das gilt auch für Exporte aus dem übrigen Vereinigten Königreich. Dadurch entsteht keine harte Landgrenze auf der irischen Insel. Dafür gibt es eine neue „Seegrenze“ zum Vereinigten Königreich. Alles in allem wurden die noch vorhandenen Unsicherheiten durch das Abkommen größtenteils beseitigt. Wie sich die Beziehung künftig entwickelt bleibt jedoch abzuwarten. Aller Voraussicht nach dürften Spannungen und Umsetzungsprobleme auftreten.

Das erste Quartal war von den langsamen und ungleichmäßigen Fortschritten in Richtung einer Normalisierung der wirtschaftlichen Lage geprägt. In den USA hoben viele Bundesstaaten die virusbedingten Mobilitätsbeschränkungen auf, was einer starken Erholung der Wirtschaftsaktivität Vorschub leistete. In vielen Ländern der Eurozone galten indes noch Lockdown-Maßnahmen, und Anzeichen eines Rückgangs der Infektionszahlen waren nicht zu erkennen.

Die Entscheidungsträger auf beiden Seiten des Atlantiks gaben im Quartalsverlauf klar zu verstehen, dass sie gewillt sind, so lange wie nötig Unterstützung bereitzustellen. Besonders deutlich wurde dies in den USA, wo der Wahlsieg der Demokraten bei der Stichwahl in Georgia Anfang Januar den Weg für die Verabschiedung eines USD 1,9 Bio. schweren Konjunkturpakets im März ebnete.

Die Normalisierung nahm Fahrt auf, was im zweiten Quartal angesichts der allmählichen Wiedereröffnung der Volkswirtschaften deutlicher wurde. Der Aufschwung wurde durch die fiskalpolitische Unterstützung, die entgegenkommende Geldpolitik, das starke Gewinnwachstum mit positiven Prognosen und die Impfkampagnen in den Industrieländern verstärkt. Die Inflationsdaten fielen höher als erwartet aus.

Zu Beginn des dritten Quartals 2021 begünstigten die meisten der schwächer ausgefallenen Fundamentaldaten der Industrieländer eine längere Phase über dem Trend liegenden Wachstums. Die Finanzlage der privaten Haushalte erschien angesichts der enormen überschüssigen Ersparnisse, die sich seit dem Frühjahr 2020 angehäuft hatten, äußerst robust. Die Kredite flossen ebenfalls ungehindert, und die Rentabilität der Unternehmen hatte sich gegenüber den Tiefständen des Vorjahres stark erholt. Die Daten zu Geschäftsklima und Verbrauchervertrauen lagen deutlich über ihren langfristigen Durchschnittswerten. Dies sprach dafür, dass die Verbraucher bereit waren, einen Teil ihrer überschüssigen Ersparnisse auszugeben, und die Unternehmen ihre Investitionsausgaben erhöhen wollten. Die Expansionsfreude der Unternehmen kam auch in einer äußerst starken Nachfrage nach Arbeitskräften zum Ausdruck, die eine weitere Stütze der Ausgaben und des Vertrauens der Verbraucher darstellte. Es war davon auszugehen, dass die geld- und fiskalpolitische Unterstützung in nächster Zeit weitgehend beibehalten werden würde.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Trotz dieser positiven fundamentalen Ausgangslage war das dritte Quartal von leicht enttäuschenden Daten geprägt. Der wichtigste Grund waren die vielen Angebotsengpässe an den Güter-, Dienstleistungs- und Arbeitsmärkten, welche die reale Wirtschaftstätigkeit einschränkten und die Preise und Löhne steigen ließen. Ein weiterer Faktor war die Ausbreitung der Deltavariante des Covid-19-Virus, die einen Teil der Angebotsengpässe verschärfte, da sie unter anderem zusätzliche Produktionsbeschränkungen in den Schwellenländern Asiens nach sich zog und Menschen aus gesundheitlichen Gründen daran hinderte, ihre Arbeit wieder aufzunehmen. Die Deltavariante dürfte das Geschäftsklima und das Verbrauchervertrauen belastet haben. Der Inflationsschub infolge der Angebotsverknappung trübte die Stimmung zusätzlich ein und könnte ein Grund dafür gewesen sein, dass das Vertrauen der US-Verbraucher stärker sank als das der Konsumenten in Europa und Japan. Das Geschäftsklima blieb insgesamt solide.

**Geldpolitik**

Sowohl die Fed als auch die EZB behielten ihre äußerst entgegenkommende Haltung im vierten Quartal 2020 bei. Die geldpolitische Stimulierung wurde sogar verstärkt, da sie eine Verlängerung und Erhöhung ihrer Wertpapierkäufe beschlossen. Zudem bekräftigten die beiden Zentralbanken in ihren zukunftsgerichteten Hinweisen (Forward Guidance) erneut, dass sie die Finanzierungskosten für Unternehmen und Staaten so lange wie nötig niedrig halten wollen.

Die EZB kündigte im ersten Quartal 2021 eine Aufstockung ihrer Wertpapierankäufe im Rahmen ihres Pandemie-Notfallankaufprogramms (PEPP) an. In der zweiten Quartalshälfte rückte die Inflation in den Vordergrund, was die Anleiherenditen Ende Februar kontinuierlich steigen ließ. Dadurch gerieten Risikoanlagen unter Druck. Während die Fed keinerlei Besorgnis bezüglich der höheren Renditen äußerte, zeigte sich die EZB angesichts des geringeren Wachstumspotenzials und der stärkeren deflationären Kräfte in der Eurozone beunruhigt über den Renditeanstieg.

Als eines der wichtigsten Ereignisse im zweiten Quartal erwies sich die Juni-Sitzung des Offenmarktausschusses der Federal Reserve, bei der die US-Zentralbank zu einem restriktiveren geldpolitischen Kurs umschwenkte, um die Inflationserwartungen zu steuern.

Im dritten Quartal 2021 zeichneten sich deutliche Unterschiede in der Art und Weise ab, wie die vier größten Zentralbanken der Industrieländer auf das leicht stagflationäre Konjunkturumfeld reagierten, das durch die Wiedereröffnungsdynamik und die Angebotsengpässe entstanden war. Die Bank of England nahm die restriktivste Haltung ein, da ihr die Aussicht auf eine dauerhaft über dem Zielwert liegende Inflation, einen Mangel an Arbeitskräften sowie steigende Löhne und Inflationserwartungen mehr Sorgen bereitete als die Wachstumsschwäche. Die Federal Reserve verfolgte einen wesentlich geduldigeren Ansatz. Sie signalisierte, dass die Rückführung ihrer Anleihekäufe im November beginnen und Ende nächsten Jahres beendet sein würde. Die meisten Mitglieder des Offenmarktausschusses der Fed waren der Ansicht, dass die Entscheidung über die Zinswende, für die wesentlich strengere Kriterien gelten, relativ unabhängig von der Entscheidung über die Drosselung der Anleihekäufe sei. Die erste Zinsanhebung wurde für 2023 in Aussicht gestellt. Die Mehrheit des EZB-Rats war zweifellos bereit, über den Inflationsschub infolge der Angebotsengpässe hinwegzusehen, und vertrat die Auffassung, dass die Geldpolitik noch eine Weile äußerst entgegenkommend bleiben sollte, um einen Anstieg der zugrunde liegende Inflation in Richtung des Zielwerts zu bewirken. Die Bank of Japan hielt die Renditekurve im Laufzeitenbereich von null bis zehn Jahren auf dem seit 2016 etablierten Niveau und dürfte dies auf absehbare Zeit weiter tun.

**Rentenmärkte**

Im vierten Quartal 2020 stiegen die Renditen zehnjähriger US-Anleihen von 0,68% (Ende September) auf 0,91% (Ende Dezember). Die Renditen zehnjähriger deutscher Bundesanleihen beendeten das Quartal um einige Basispunkte tiefer bei -0,57%. Der Markt für Anleihen aus den Randländern der Eurozone war im vierten Quartal gewissen Schwankungen ausgesetzt, in denen die allgemeine Risikostimmung zum Ausdruck kam. Er beendete das Quartal jedoch mit engeren Spreads gegenüber deutschen Bundesanleihen.

Staatsanleihen entwickelten sich im ersten Quartal 2021 eher schwach, was vor allem dem besseren Wachstumsausblick in den USA geschuldet war. Durch ihren Sieg bei der Stichwahl im US-Bundesstaat Georgia gewannen die Demokraten die Kontrolle im Senat, was die Verabschiedung eines zusätzlichen Covid-19-Hilfspakets im Umfang USD von 1,9 Bio. ermöglichte. Außerdem verfestigte sich der Erholungspfad der Wirtschaftsaktivität aufgrund der raschen Impfstoffverteilung. Vor diesem Hintergrund stieg die Rendite zehnjähriger US-Anleihen von 0,91% (Ende 2020) auf 1,75% (Ende März 2021). Die Rendite zehnjähriger deutscher Anleihen zog im selben Zeitraum von - 0,58% auf -0,33% an.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Maßgeblich verantwortlich für die höheren Anleiherenditen waren zunächst die gestiegenen Inflationserwartungen. Später zogen jedoch auch die realen Renditen deutlich an, obwohl die Zentralbanken zu verstehen gaben, dass eine weniger entgegenkommende Geldpolitik noch längst nicht zur Debatte stünde. Durch den Anstieg der realen Anleiherenditen gerieten Risikoanlagen im Quartal leicht unter Druck. Die meisten Spreads von Unternehmensanleihen und die Spreads von Staatsanleihen aus der Eurozone gegenüber Deutschland engten sich im Quartal daher nicht ein. Die wichtigste Ausnahme bildete die Spreadverengung bei italienischen Staatsanleihen gegenüber Deutschland, in der sich das Vertrauen der Märkte in die neue Regierung unter Führung von Mario Draghi widerspiegelte.

Im zweiten Quartal kam es zu einer Verengung des Renditespreads zwischen US- und deutschen Papieren, die unseres Erachtens ein vorübergehendes Phänomen sein dürfte. Die Spreads von Hochzins- und Papieren mit hohem Bonitätsrating verengten sich. Die niedrigeren US-Renditen befeuerten die Renditesuche und wirkten sich ebenso wie die rasche Verbesserung der Rentabilität der Unternehmen günstig aus.

Die Renditen sicherer Staatsanleihen zogen im August 2021 angesichts der restriktiveren Zentralbanken und der erneut unerwartet hoch ausgefallenen Inflationsdaten erstmals wieder an. Im Kreditsegment präsentierten sich die Spreads von Titeln mit hohem Bonitätsrating stabil, während sich die Spreads im Hochzinssegment ausweiteten.

**Aktienmärkte**

Im vierten Quartal 2020 legten Aktien 9,3% zu, womit sich der Zugewinn seit Jahresbeginn auf 6,9% summiert. Die Impfstoffankündigungen führten im November und Dezember zu bedeutenden Umschichtungen. Technologie und Kommunikationsdienste blieben hinter eher substanzorientierten Sektoren wie Finanzen und Energie zurück. Die traditionell defensiven Branchen wie Gesundheit, Versorger und Basiskonsumgüter bildeten die Schlusslichter. Auf regionaler Ebene hatten Märkte, in denen zyklische und Substanzwerte stärker vertreten sind, wie Europa, Japan und die Schwellenländer außerhalb Asiens gegenüber Märkten mit höherem Anteil an Wachstumstiteln wie die USA die Nase vorn.

Der Beginn des Jahres 2021 gestaltete sich erfreulich, da mehrere brennende politische Probleme vom Tisch waren, darunter der Brexit, die US-Wahlen und die Verabschiedung des mehrjährigen EU-Haushalts. Durch ihren Doppelsieg bei der Stichwahl in Georgia konnten sich die Demokraten die Mehrheit im US-Senat sichern. Infolgedessen sank die haushaltspolitische Unsicherheit und die Fähigkeit des US-Präsidenten, seine wirtschaftlichen Vorhaben durchzusetzen, wurde gestärkt. Die Rückschläge bei den Impfkampagnen, die unter anderem durch Lieferprobleme und das Aufkommen ansteckenderer Virus-Varianten verursacht wurden, konnten den Optimismus der Anleger offenbar nicht bremsen. Gegen Ende Januar entstand technischer Druck, da Kleinanleger ihre Mittel bündelten, um gegen einige der größten Short-Positionen am Markt zu wetten. Dadurch entstand ein massiver Short-Squeeze, der die Aktienmärkte in Aufruhr versetzte.

Was die Regionen anbelangt, so setzten die Märkte außerhalb der USA ihre Outperformance Anfang Januar fort, allen voran die Schwellenländer, die durch die Zugewinne an den asiatischen Märkten begünstigt wurden. Die zweite Monatshälfte war durch ein höheres Maß an Konvergenz geprägt. Die Aktienmärkte der Eurozone erreichten den Tiefpunkt. Sie litten unter dem langsamen Start der Impfkampagnen, weiteren Mobilitätsbeschränkungen und der suboptimalen Kommunikation der EZB, deren Äußerungen zu ihrem künftigen geldpolitischen Kurs nicht ganz eindeutig waren. Eine ähnliche Entwicklung war bei den Sektoren zu beobachten: Rohstoffe, zyklische Werte und Finanztitel starteten stark ins neue Jahr, defensive Sektoren und große Technologieunternehmen verbuchten indes einen schwachen Jahresauftakt. Gegen Monatsende nivellierten sich die Performanceunterschiede zwischen beiden Gruppen wieder. Diese Annäherung der Wertentwicklung von gut und schlecht abschneidenden Sektoren war leider eine Konvergenz aus „falschem“ Grund. Denn die Verwerfungen, die durch aktivistisch agierende Kleinanleger verursacht wurden, spielten dabei ein bedeutende Rolle.

Die Weltaktienmärkte setzten ihre Aufwärtsbewegung im April wieder fort. Die Unternehmen legten starke Ergebnisse für das erste Quartal vor. In den USA fielen die Ergebnisse von 85% der Unternehmen besser aus als erwartet, wobei die Gewinnprognosen im Schnitt um über 25% übertroffen wurden. Das absolute Gewinnwachstum lag deutlich über 50%. Ähnlich positive Ergebnisse vermeldeten die Unternehmen aus der Eurozone. Die Vorgaben waren ebenfalls optimistisch, was eine Aufwärtsrevision der Konsensprognose für die Gewinne der nächsten Quartale zur Folge hatte.

Auf regionaler Ebene fiel die Performance von Aktien uneinheitlich aus. Am besten schnitten die USA ab, wo sich das neuerliche Interesse an Wachstumssektoren in der zweiten Quartalshälfte günstig auswirkte. Dicht dahinter folgte Europa. Japan bildete das Schlusslicht, obwohl japanische Aktien von der globalen Erholung profitieren dürften. Vermutlich spielten die stagnierenden Impfquoten eine wichtige Rolle bei der Underperformance.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Aktien aus den Schwellenländern entwickelten sich im zweiten Quartal ebenfalls unterdurchschnittlich, wobei enorme Unterschiede zwischen den schwachen asiatischen und den starken Schwellenmärkten außerhalb Asiens erkennbar waren. Zurückzuführen war dies sicherlich auch auf die starken Öl- und Industriemetallpreise und die Stärke von Rohstoffwährungen. Ein weiterer Grund war der Kampf gegen die Pandemie in mehreren asiatischen Schwellenländern, der ihre Wachstumsaussichten beeinträchtigt und zweifellos ein Belastungsfaktor für die Schwellenländer ist.

Die Schwellenländer konnten auch im dritten Quartal 2021 infolge der Pandemie nicht Schritt halten. Die niedrigen Impfquoten und die Null-Toleranz-Politik waren dem Wachstum nicht förderlich. China hatte ebenfalls mit Problemen zu kämpfen. Diese hingen hauptsächlich mit dem Immobiliengiganten Evergrande zusammen, der in ernsthafte finanzielle Schwierigkeiten geraten war. Überdies stellen Stromausfälle ein Risiko für das chinesische Wachstum dar. Einige Belastungsfaktoren waren hausgemacht, so etwa die regulatorischen Auflagen für die Sektoren Technologie, Bildung und Glücksspiele. Die Abwärtsrisiken für das Wachstum stiegen, und die Lockerungsmaßnahmen fielen relativ moderat aus. Außerhalb Chinas wurde die Geldpolitik im Großen und Ganzen restriktiver.

Unter den Industrieländern schnitt Japan am besten ab. Angesichts der Ankündigung, dass Premierminister Yoshihide Suga zurücktreten und Fumio Kishida sein Amt übernehmen würde, stieg die Wahrscheinlichkeit, dass die Liberaldemokratische Partei nach den Unterhauswahlen im November im Amt bleiben würde. In der Vergangenheit haben sich japanische Aktien im Vorfeld von Wahlen gut entwickelt.

Die Performance der einzelnen Sektoren fiel im dritten Quartal uneinheitlich aus. Die einzige Ausnahme bildete der Energiesektor, der vom Aufwärtstrend bei den zugrunde liegenden Rohstoffpreisen begünstigt wurde. Im Sommer verzeichneten die Sektoren Technologie, Kommunikationsdienste und Finanzwerte die beste Wertentwicklung. Im September gingen die Märkte jedoch infolge der Trendwende bei den Anleiherenditen zu einer stärker substanzorientierten Positionierung über. Sektoren mit hohem Wachstumspotenzial wie Technologie und Kommunikationsdienste, die in der Regel eine negative Korrelation zu den Anleiherenditen aufweisen und ganz oben auf der Performance-Rangliste standen, bildeten nunmehr das Schlusslicht.

**Ausblick**

Die wirtschaftliche Normalisierung setzt sich fort, allerdings in ungleichmäßigem Tempo nach den langen coronabedingten Lockdowns. In den meisten westlichen Ländern erscheinen weitere umfassende Lockdowns unwahrscheinlich. Aufgrund der Angebotsengpässe sind die kurzfristigen makroökonomischen Aussichten unklar. Die Inflationsraten sind deutlich gestiegen. Wir halten dies jedoch für ein vorübergehendes Phänomen. Was die Geldpolitik anbelangt, so dürfte die Federal Reserve bald mit der Drosselung ihrer Wertpapierkäufe beginnen. Auf mittlere Sicht hängt die Nachhaltigkeit der Erholung vom Infektionsgeschehen, der vorübergehenden Natur der hohen Teuerungsrate, der Bereitschaft der politischen Entscheidungsträger, die entgegenkommende Politik fortzusetzen, und der Freisetzung der überschüssigen Ersparnisse und privaten Investitionen ab.

Angesichts fehlender profitabler Alternativen werden sich die Anleger weiter bei Risikoanlagen engagieren und die Märkte nach oben treiben. Es besteht mehr Zurückhaltung als Anfang des Jahres, als ein derartiges Anlegerverhalten angesichts der Fundamentaldaten von Wirtschaft, Unternehmen und Politik noch völlig gerechtfertigt war. Die Volatilität steigt. Eine neuerlicher zyklischer Aufschwung an den Märkten im vierten Quartal ist möglich. Allerdings dürften die Herausforderungen in den kommenden Quartalen steigen, da sich die Daten normalisieren und die Politik aus dem Notstandsmodus aussteigt. Darüber hinaus sollten das chinesische Wachstum und die Politik der Volksrepublik genau im Auge behalten werden.

**Covid-19 und Betriebskontinuitätsplan**

Nach einem volatilen zweiten Quartal 2020 erholte sich die Weltwirtschaft im dritten Quartal insgesamt recht stark von den Tiefständen der Covid-19-bedingten Rezession. Ab dem vierten Quartal 2020 belastete die zweite Coronawelle die Märkte der meisten Industrieländer und hatte stärkere Einschränkungen und eine höhere Marktvolatilität zur Folge. Im November gab es positive Meldungen über die Entwicklung von Impfstoffen, und im ersten und zweiten Quartal starteten die ersten Impfkampagnen in verschiedenen Teilen der Welt. Im Zuge steigender Impfquoten nahmen auch die Normalisierung der Wirtschaft und die Wiedereröffnungen Fahrt auf. Dadurch sank die Volatilität, und die Aktienindizes erklommen wieder ihre historischen Höchststände. Die Renditen von Anleihen gaben im letzten Jahr hingegen nach, wofür die steigende Inflation verantwortlich war. Obwohl sich die wirtschaftliche Normalisierung im dritten Quartal fortsetzte, zog die Volatilität an den asiatischen Immobilienmärkten an, da mehrere chinesische Immobilienentwickler ausfielen, was Sorgen über mögliche Ansteckungseffekte vor allem in den Schwellenländern schürte.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

NN IP verfügt über einen aktiven Risiko- und Portfolioverwaltungsprozess, mit dem das Markt- und das Liquiditätsrisiko täglich bewertet und gegebenenfalls Portfolioanpassungen vorgenommen werden. Daneben wird die Einhaltung der Prospekt- und regulatorischen Richtlinien ständig überwacht. Falls nötig, werden Abhilfemaßnahmen ergriffen. Die aktuellen Prozesse werden als wirksam eingestuft, um weiterhin eine effektive Portfolioverwaltung sicherzustellen.

NN IP hat den Betriebskontinuitätsplan (BCP) aktiviert. Die IT-Infrastruktur wurde erweitert, sodass die Mehrheit der Mitarbeiter von zuhause aus arbeiten und auf alle Systeme zugreifen kann. NN IP verwaltet die Portfolios unter den gegebenen Umständen weiter, und es gab keine wesentlichen Beeinträchtigungen unseres operativen Kontrollrahmens. Nichts deutet darauf hin, dass sich die gegenwärtige Krise negativ die Lebensfähigkeit des Fonds oder des Verwalters auswirkt.

Unsere Mitarbeiter arbeiten weiterhin größtenteils von zuhause aus und nur bei Bedarf im Büro. Wesentliche Störungen unserer Abläufe gibt es nicht. Wir gehen davon aus, dass eine Kombination aus Heim- und Büroarbeit infolge der Covid-19-Pandemie zur Regel wird.

**Marktentwicklung**

Die Portfolioverwaltungsteams von NN IP überwachen und bewerten die Marktentwicklung, die Liquidität der Aktivseite und die Kapitalflussdaten kontinuierlich, um eine zeitnahe Reaktion auf das sich wandelnde Marktumfeld sicherzustellen. Dabei werden sie von Spezialisten mit funktionsübergreifender Expertise unterstützt. Das Team prüft die Wirksamkeit der ergriffenen Maßnahmen in regelmäßigen Abständen, um die Volatilität der Transaktionskosten zu steuern. In der Folge werden Maßnahmen zur Wahrung der Interessen der Kunden umgesetzt. Derzeit erfolgt keine spezifische Covid-19-Überwachung mehr. Eine Periode erhöhter Volatilität an den Finanzmärkten in Bezug auf Covid-19 lässt sich nicht ausschließen. Sollte die Volatilität künftig steigen, wird das Management die diesbezüglich durchgeführten Überwachungsaktivitäten nötigenfalls anpassen.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

| 1-Jahres-Performance, Stand: 30. September 2021 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **Bezeichnung des Teilfonds** | **Bezeichnung der Anteilsklasse** | **Brutto-performance %** | **Netto-performance %** | **Relative Brutto-performance %[1]** | **Relative Netto-performance %[1]** |
| NN (L) AAA ABS | Capitalisation I EUR | 0,78 | 0,53 | 0,85 | 0,6 |
| NN (L) Alternative Beta | Capitalisation P USD | 16,77 | 15,22 | 7,9 | 6,35 |
| NN (L) Asia Income | Capitalisation P USD | 18,3 | 16,09 | 3,39 | 1,18 |
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | Capitalisation P USD | -0,83 | -2,1 | -1,52 | -2,79 |
| NN (L) Asian High Yield | Capitalisation I USD | -1,32 | -2,18 | -5,48 | -6,34 |
| NN (L) Banking & Insurance | Capitalisation P USD | 47,67 | 45,07 | -5,1 | -7,7 |
| NN (L) Belgian Government Bond | Capitalisation P EUR | -3,57 | -4,34 | -0,03 | -0,79 |
| NN (L) Climate & Environment | Capitalisation P EUR | 30,56 | 28,26 | - | - |
| NN (L) Commodity Enhanced | Capitalisation I USD | 41,32 | 40,32 | -0,97 | -1,97 |
| NN (L) Corporate Green Bond | Capitalisation I EUR | 1,66 | 1,33 | 0,06 | -0,27 |
| NN (L) Emerging Europe Equity | Capitalisation P EUR | 45,91 | 43,2 | -4,39 | -7,1 |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | Capitalisation I USD | 6,3 | 5,38 | 0,79 | -0,13 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | Capitalisation P USD | 6,18 | 4,61 | 1,82 | 0,25 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond) | Capitalisation I USD | 3,05 | 2,15 | 0,42 | -0,48 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency) | Capitalisation I USD | 3,73 | 2,81 | 0,06 | -0,86 |
| NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency) | Capitalisation I USD | 2,09 | 1,42 | 1,95 | 1,28 |

[1] Die relative Performance ist im Vergleich zum offiziellen Referenzwert des Fonds dargestellt. In einigen Fällen wird der Referenzwert lediglich zur Messung der Performance herangezogen.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

| 1-Jahres-Performance, Stand: 30. September 2021 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **Bezeichnung des Teilfonds** | **Bezeichnung der Anteilsklasse** | **Brutto-performance %** | **Netto-performance %** | **Relative Brutto-performance %[1]** | **Relative Netto-performance %[1]** |
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity | Capitalisation P USD | 18,64 | 17,94 | 0,44 | -0,27 |
| NN (L) Emerging Markets High Dividend | Capitalisation P EUR | 16,19 | 14,03 | -3,42 | -5,58 |
| NN (L) Energy | Capitalisation P USD | 63,38 | 60,5 | -7,55 | -10,43 |
| NN (L) Euro Covered Bond | Capitalisation I EUR | -1,13 | -1,5 | 0,18 | -0,19 |
| NN (L) Euro Credit | Capitalisation I EUR | 2,56 | 2,06 | 0,9 | 0,4 |
| NN (L) Euro Equity | Capitalisation P EUR | 31,86 | 29,8 | 1,51 | -0,56 |
| NN (L) Euro Fixed Income | Capitalisation P EUR | -0,58 | -1,42 | 0,48 | -0,36 |
| NN (L) Euro High Dividend | Capitalisation P EUR | 31,85 | 29,53 | 1,5 | -0,83 |
| NN (L) Euro Income | Capitalisation P EUR | 30,63 | 28,33 | 0,28 | -2,02 |
| NN (L) Euro Liquidity | Capitalisation P EUR | -0,45 | -0,62 | 0,08 | -0,08 |
| NN (L) Euro Long Duration Bond | Capitalisation N EUR | -4,08 | -4,46 | -0,16 | -0,54 |
| NN (L) Euro Short Duration | Capitalisation P EUR | -0,09 | -0,88 | 0,28 | -0,51 |
| NN (L) Euro Sustainable Credit | Capitalisation I EUR | 2,23 | 1,74 | 0,57 | 0,07 |
| NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials) | Capitalisation P EUR | 1,81 | 0,96 | 0,38 | -0,48 |
| NN (L) Euromix Bond | Capitalisation P EUR | -1,23 | -2,06 | 0,13 | -0,7 |
| NN (L) European ABS | Capitalisation N EUR | 3,23 | 2,87 | 3,77 | 3,41 |
| NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity | Capitalisation I EUR | 31,11 | 30,86 | 2,35 | 2,1 |
| NN (L) European Equity | Capitalisation P EUR | 32,54 | 30,46 | 3,78 | 1,71 |
| NN (L) European High Dividend | Capitalisation P EUR | 28,25 | 25,99 | -0,51 | -2,76 |
| NN (L) European High Yield | Capitalisation I EUR (hedged ii) | 10,37 | 9,39 | 1,02 | 0,03 |
| NN (L) European Participation Equity | Capitalisation I EUR | 55,96 | 54,72 | - | - |
| NN (L) European Real Estate | Capitalisation P EUR | 19,54 | 17,66 | -3,16 | -5,04 |

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

| 1-Jahres-Performance, Stand: 30. September 2021 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **Bezeichnung des Teilfonds** | **Bezeichnung der Anteilsklasse** | **Brutto-performance %** | **Netto-performance %** | **Relative Brutto-performance %[1]** | **Relative Netto-performance %[1]** |
| NN (L) European Sustainable Equity | Capitalisation I EUR | 24,52 | 23,52 | -4,24 | -5,24 |
| NN (L) First Class Multi Asset | Capitalisation I EUR | 6,84 | 6,12 | 7,4 | 6,68 |
| NN (L) First Class Multi Asset Premium | Capitalisation P EUR | 9,95 | 8,3 | 10,51 | 8,86 |
| NN (L) First Class Protection | Capitalisation P EUR | 4,53 | 3,53 | - | - |
| NN (L) First Class Stable Yield Opportunities | Distribution N (Q) EUR | 3,81 | 3,35 | 4,38 | 3,91 |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | Capitalisation P EUR | 6,33 | 5,06 | 6,89 | 5,63 |
| NN (L) Food & Beverages | Capitalisation P USD | 5,86 | 3,98 | -4 | -5,87 |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | Capitalisation I USD | 11,85 | 10,87 | 1,05 | 0,08 |
| NN (L) Global Bond Opportunities | Capitalisation I EUR | 5,82 | 5,3 | 5,56 | 5,04 |
| NN (L) Global Convertible Bond | Capitalisation P USD | 10,91 | 9,6 | -0,73 | -2,05 |
| NN (L) Global Convertible Opportunities | Capitalisation I USD | 10,92 | 9,95 | -0,72 | -1,69 |
| NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity | Capitalisation I USD | 28,55 | 28,3 | -0,27 | -0,52 |
| NN (L) Global Equity Impact Opportunities | Capitalisation I EUR | 28,27 | 27,24 | - | - |
| NN (L) Global High Dividend | Capitalisation P EUR | 31,91 | 29,59 | 1,57 | -0,76 |
| NN (L) Global High Yield | Distribution X (M) USD | 11,69 | 9,71 | 1,27 | -0,7 |
| NN (L) Global Inflation Linked Bond | Capitalisation N EUR (hedged iii) | 2,8 | 2,22 | -0,36 | -0,94 |
| NN (L) Global Investment Grade Credit | Capitalisation I EUR | 4,24 | 3,74 | 1,32 | 0,81 |
| NN (L) Global Real Estate | Capitalisation I EUR | 27,45 | 26,58 | -4,45 | -5,32 |
| NN (L) Global Sustainable Equity | Capitalisation P EUR | 32,36 | 30,02 | 2,02 | -0,32 |
| NN (L) Greater China Equity | Capitalisation P USD | 13,35 | 11,23 | 6,45 | 4,34 |
| NN (L) Green Bond | Capitalisation I EUR | -1,02 | -1,34 | 0,49 | 0,16 |
| NN (L) Green Bond Short Duration | Distribution I EUR | 0,71 | 0,38 | - | - |

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

| 1-Jahres-Performance, Stand: 30. September 2021 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| **Bezeichnung des Teilfonds** | **Bezeichnung der Anteilsklasse** | **Brutto-performance %** | **Netto-performance %** | **Relative Brutto-performance %[1]** | **Relative Netto-performance %[1]** |
| NN (L) Health & Well-being | Capitalisation P EUR | 26,71 | 24,47 | - | - |
| NN (L) Health Care | Capitalisation P USD | 15,69 | 13,64 | -2,93 | -4,98 |
| NN (L) Japan Equity | Capitalisation P JPY | 37,06 | 34,9 | 8 | 5,84 |
| NN (L) Multi Asset Factor Opportunities | Capitalisation I USD | 13,82 | 12,91 | 13,73 | 12,81 |
| NN (L) Multi Asset High Income | Capitalisation I EUR | 12,19 | 11,1 | - | - |
| NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity | Capitalisation I USD | 27,6 | 27,36 | -2,52 | -2,77 |
| NN (L) Smart Connectivity | Capitalisation I USD | 25,15 | 24,14 | - | - |
| NN (L) Sovereign Green Bond [(1)] | Capitalisation I EUR | - | - | - | - |
| NN (L) US Behavioural Equity [(2)] | Capitalisation I USD | - | - | - | - |
| NN (L) US Credit | Capitalisation P USD | 3,25 | 2,28 | 1,51 | 0,54 |
| NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity | Capitalisation P USD | 30,34 | 28,3 | 0,91 | -1,13 |
| NN (L) US Factor Credit | Capitalisation P USD | 3,03 | 2,16 | 1,29 | 0,42 |
| NN (L) US Growth Equity [(3)] | Capitalisation I USD | - | - | - | - |
| NN (L) US High Dividend | Capitalisation P USD | 28,68 | 26,41 | -0,75 | -3,01 |
| NN (L) US High Yield | Capitalisation I USD | 13,47 | 12,48 | 2,01 | 1,02 |

[(1)]Der Teilfonds NN (L) Sovereign Green Bond wurde am 31. März 2021 aufgelegt
[(2)]Der Teilfonds NN (L) US Behavioural Equity wurde am 10. Mai 2021 aufgelegt
[(3)]Der Teilfonds NN (L) US Growth Equity wurde am 22. September 2021 liquidiert

**ESG: Umwelt (Environment, E), Soziales (Social, S) und Unternehmensführung (Governance, G)**

Verantwortungsbewusstes Investieren (Responsible Investing, RI) ist das zentrale Element unserer Anlagephilosophie, auf das sich die Anlageüberzeugungen von NN Investment Partners (NN IP) stützten. Unser Responsible Investing Framework umfasst die zugrundeliegenden RI-Überzeugungen, die vier Bausteine und das Ergebnis: unsere ESG-integrierten, Nachhaltigkeits- und Impact-Anlagestrategien[2]. Wir sind seit 2008 Unterzeichner der Prinzipien für verantwortungsbewusstes Investieren (PRI).

Wir glauben, dass die Einbeziehung ökologischer, sozialer und Governance-Faktoren (ESG-Faktoren) den Entscheidungsprozess verbessert. Durch die Berücksichtigung finanzieller und nichtfinanzieller Informationen in unseren Portfolien sind wir besser imstande, die kurz- und langfristigen risikobereinigten Renditen zu optimieren. Eine konsequente Integration von ESG-Faktoren befähigt uns, Risiken und Chancen zu identifizieren, und hilft uns, Wertpotenzial zu erschließen und gleichzeitig die positiven gesellschaftlichen und ökologischen Wirkungen zu erzielen, die wir als verantwortungsbewusster Anleger anstreben.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

[2]Weitere Informationen sind auf der Website nnip.com zu finden.

Als Aktionär und Kapitalgeber sind wir uns unserer Rolle und Verantwortung bewusst, die uns als Impulsgeber des Wandels durch unser Engagement und die Ausübung von Stimmrechten zukommt. Indem wir mit den Unternehmen, in die wir investieren, in einen konstruktiven und regelmäßigen Dialog über ESG-Faktoren treten, können wir sie bei der Bewältigung zahlreicher Probleme unterstützen.

Wir stecken unser Anlageuniversum ab, indem wir kontroverse Aktivitäten wie umstrittene Waffen und Ölsande ausschließen. Im Berichtszeitraum wurden in Bezug auf die Geschäftsaktivitäten keine neuen Ausschlusskriterien festgelegt.

Mit unserem breiten Spektrum an speziellen Nachhaltigkeitsfonds und -lösungen helfen wir unseren Kunden, ihre finanziellen und Nachhaltigkeitsziele zu erreichen. Im Berichtszeitraum wurden weitere Nachhaltigkeitsfonds aufgelegt. NN IP beteiligt sich aktiv an einer Reihe internationaler Nachhaltigkeitsinitiativen. Indem wir eine aktive Rolle bei diesen Partnerschaften übernehmen, können wir mit unseren Bemühungen stärkere Wirkung erzielen.

**Einstufung nach der Verordnung über nachhaltigkeitsbezogene Offenlegungspflichten im Finanzdienstleistungssektor (SFDR)**

| Bezeichnung des Teilfonds | Einstufung |
|---|---|
| NN (L) AAA ABS | 6 |
| NN (L) Alternative Beta | 6 |
| NN (L) Asia Income | 6 |
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | 8 |
| NN (L) Asian High Yield | 8 |
| NN (L) Banking & Insurance | 8 |
| NN (L) Belgian Government Bond | 8 |
| NN (L) Climate & Environment | 9 |
| NN (L) Commodity Enhanced | 6 |
| NN (L) Corporate Green Bond | 9 |
| NN (L) Emerging Europe Equity | 8 |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | 8 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | 8 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond) | 8 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency) | 8 |
| NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency) | 8 |
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity | 9 |
| NN (L) Emerging Markets High Dividend | 8 |
| NN (L) Energy | 8 |
| NN (L) Euro Covered Bond | 8 |
| NN (L) Euro Credit | 8 |
| NN (L) EURO Equity | 8 |
| NN (L) Euro Fixed Income | 8 |
| NN (L) Euro High Dividend | 8 |
| NN (L) Euro Income | 8 |

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

| Bezeichnung des Teilfonds | Einstufung |
|---|---|
| NN (L) Euro Liquidity | 8 |
| NN (L) Euro Long Duration Bond | 8 |
| NN (L) Euro Short Duration | 8 |
| NN (L) Euro Sustainable Credit | 9 |
| NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials) | 9 |
| NN (L) Euromix Bond | 8 |
| NN (L) European ABS | 6 |
| NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity | 9 |
| NN (L) European Equity | 8 |
| NN (L) European High Dividend | 8 |
| NN (L) European High Yield | 8 |
| NN (L) European Participation Equity | 8 |
| NN (L) European Real Estate | 8 |
| NN (L) European Sustainable Equity | 9 |
| NN (L) First Class Multi Asset | 8 |
| NN (L) First Class Multi Asset Premium | 8 |
| NN (L) First Class Protection | 8 |
| NN (L) First Class Stable Yield Opportunities | 8 |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | 8 |
| NN (L) Food & Beverages | 8 |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | 8 |
| NN (L) Global Bond Opportunities | 8 |
| NN (L) Global Convertible Bond | 8 |
| NN (L) Global Convertible Opportunities | 8 |
| NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity | 9 |
| NN (L) Global Equity Impact Opportunities | 9 |
| NN (L) Global High Dividend | 8 |
| NN (L) Global High Yield | 8 |
| NN (L) Global Inflation Linked Bond | 8 |
| NN (L) Global Investment Grade Credit | 8 |
| NN (L) Global Real Estate | 8 |
| NN (L) Global Sustainable Equity | 9 |
| NN (L) Greater China Equity | 6 |
| NN (L) Green Bond | 9 |
| NN (L) Green Bond Short Duration | 9 |
| NN (L) Health & Well-being | 9 |

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

| Bezeichnung des Teilfonds | Einstufung |
|---|---|
| NN (L) Health Care | 8 |
| NN (L) Japan Equity | 6 |
| NN (L) Multi Asset Factor Opportunities | 6 |
| NN (L) Multi Asset High Income | 8 |
| NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity | 9 |
| NN (L) Smart Connectivity | 9 |
| NN (L) Sovereign Green Bond | 9 |
| NN (L) US Behavioural Equity | 8 |
| NN (L) US Credit | 6 |
| NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity | 6 |
| NN (L) US Factor Credit | 8 |
| NN (L) US Growth Equity* | - |
| NN (L) US High Dividend | 6 |
| NN (L) US High Yield | 8 |

* Der Teilfonds NN (L) US Growth Equity wurde am 22. September 2021 liquidiert.

**Unter Artikel 8 fallende Fonds**

Der Fonds, der als unter Artikel 8 fallend eingestuft wurde, wandte zur Definition der ökologischen (E) und sozialen (S) Kriterien das Rahmenwerk zur Wesentlichkeit von NN IP (NN IP Materiality Framework) an, das die Faktoren Klimawandel, Ressourcennutzung und Verschmutzung, Produktverantwortung sowie Menschenrechte und Humankapital umfasst[3]. Ökologische sowie soziale Innovationen und Chancen wurden bei der Bewertung des Geschäftsmodells der Emittenten ebenfalls berücksichtigt. Die vorgenannten Merkmale wurden im Jahresverlauf im Einklang mit der im Prospekt definierten Anlagepolitik und anhand unserer Politik für verantwortungsbewusstes Investieren überwacht. Die Anwendung der normenbasierten Kriterien für verantwortungsbewusste Anlagen und die Einhaltung der Politik von NN IP für verantwortungsbewusstes Investieren sowie der Ausschlussliste der Verwaltungsgesellschaft, die bindende Elemente des Auswahlprozesses für Anlagen sind, bilden die Voraussetzung, die erfüllt sein muss, bevor eine Anlage getätigt wird.

**Unter Artikel 9 fallende Fonds**

**Grüne Anleihefonds**

Gegenstand der Green-Bond-Strategien von NN IP ist die Verwaltung grüner Anleihen, die von supranationalen, unterstaatlichen und staatsnahen Emittenten sowie Unternehmen ausgegeben wurden, die eine Politik der nachhaltigen Entwicklung verfolgen und gleichzeitig ökologische, soziale und die Unternehmensführung betreffende Grundsätze einhalten. Im Einklang mit der Definition von „grünen Anleihen“ investierten die Fonds in Instrumente, deren Erlöse zur Finanzierung oder Refinanzierung eines Teils oder aller neuen und/oder bestehenden Projekte verwendet wurden, die messbar positive Auswirkungen auf die Umwelt haben. Neben der Politik von NN IP für verantwortungsbewusstes Investieren und der Ausschlussliste wandten die Fonds die normenbasierten Kriterien für verantwortungsbewusste Anlagen der Verwaltungsgesellschaft an. Diese Ausschlussfilter beziehen sich auf Aktivitäten und Verhaltensweisen. Emittenten, bei denen gravierende und strukturelle Probleme im Hinblick auf ESG-Kontroversen bestanden, wurden ausgeschlossen. Überdies hielten die Fonds die von der International Capital Market Association formulierten Grundätze für grüne Anleihen ein.

Da die Anlagestrategien für grüne Anleihen allesamt nachhaltige Anlageziele verfolgen, bestanden für Anlagen bei diesen Emittenten, einschließlich jener, die an Aktivitäten beteiligt sind, die einen Bezug zu Glücksspiel, Waffen, Erwachsenenunterhaltung, Pelze und Spezialleder, Bohrungen in der Arktis sowie Schieferöl und -gas aufweisen, strengere Einschränkungen.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

[3] Weitere Informationen sind auf der Website nnip.com zu finden.

Da es ein Merkmal grüner Anleihefonds ist, in Projekte zu investieren, die sich günstig auf die Umwelt auswirken, bestand die nachhaltigkeitsbezogene Gesamtauswirkung der eingesetzten Strategie in den Treibhausgasemissionen, die jährlich infolge des effizienteren Energieeinsatzes vermieden und in Tonnen $CO_2$ gemessen wurden. Sie wurden auf monatlicher Basis erfasst.

Treibhausgasemissionen werden in Kohlendioxidäquivalenten ($CO_2e$) gemessen. Diese Messgröße gibt die Menge $CO_2$ eines Treibhausgases an, die seinem globalen Erwärmungspotenzial (Global Warming Potential, GWP) entspricht. Vermiedene Emissionen können aus einem breiten Spektrum an Projekten stammen. Das können Anlagen für erneuerbare Energieträger, die zur Reduzierung der Nutzung fossiler Brennstoffe beitragen, oder öffentliche Verkehrsmittel sein, die eine Alternative zu privat genutzten Automobilen darstellen. Andere Projekte umfassen beispielsweise „grüne" Gebäude, welche den Energie- und Wasserverbrauch begrenzen, um die Umweltauswirkungen der Immobilie zu verringern, oder die Glasfasertechnologie, welche die Energieeffizienz verbessert.

Die folgenden Fonds schneiden anhand dieser Indikatoren wie folgt ab (Stand: 30. September 2021)[4]:

| Bezeichnung des Fonds | Vermiedene jährliche Treibhausgasemissionen (Tonnen $CO_2$ pro Portfolio –Stand: 30.09.2021) | Vermiedene jährliche Treibhausgasemissionen (Tonnen $CO_2$ je investierter Millionen –Stand: 30.09.2021) |
|---|---|---|
| NN (L) Green Bond | 343.362 | 245 |
| NN (L) Green Bond Short Duration | 54.745 | 237 |
| NN (L) Corporate Green Bond | 171.662 | 331 |
| NN (L) Sovereign Green Bond | 34.723* | 202* |

**Der Fonds wurde am 31. Mai 2021 aufgelegt, und die Auswirkung wurde auf Basis des Zwölf-Monats-Zeitraums bis zum 30. September 2021 geschätzt.*

**Impact-Aktienfonds**

Die Impact-Aktienfonds von NN IP haben in Unternehmen investiert, die aktiv dazu beitragen, drei globale Herausforderungen zu meistern: Sicherung von Gesundheit und Wohlergehen der Menschen, Schutz des Planeten, auf dem wir leben, und Stärkung des Zugangs zu finanziellem Wohlstand.

Neben der Politik von NN IP für verantwortungsbewusstes Investieren und der Ausschlussliste wandten die Impact-Aktienfonds die normenbasierten Kriterien für verantwortungsbewusste Anlagen der Verwaltungsgesellschaft an. Diese Ausschlussfilter beziehen sich auf Aktivitäten und Verhaltensweisen. Emittenten, bei denen gravierende und strukturelle Probleme im Hinblick auf ESG-Kontroversen bestanden, wurden ausgeschlossen.

Da die Fonds Impact-Anlageziele verfolgen, bestanden für Anlagen bei diesen Emittenten, einschließlich jener, die an Aktivitäten beteiligt sind, die einen Bezug zu Glücksspiel, Waffen, Erwachsenenunterhaltung, Pelze und Spezialleder, Bohrungen in der Arktis sowie Schieferöl und -gas aufweisen, strengere Einschränkungen.

Zur Messung der nachhaltigkeitsbezogenen Gesamtwirkung der Fonds wurde das Exposure gegenüber dem jeweiligen Nachhaltigkeitsziel (Sustainable Development Goal, SDG) berücksichtigt. Für die einzelnen Fonds wurden unterschiedliche Nachhaltigkeitsziele bewertet, die mit ihrem speziellen Impact-Ziel verbunden sind. Dieses Exposure wurde auf monatlicher Basis erfasst.

[4] Weitere Informationen sind auf der Website nnip.com zu finden.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Die folgenden Fonds schneiden anhand dieser Indikatoren wie folgt ab (Stand: 30. September 2021. Für jeden Teilfonds wurden die jeweils relevanten SDG angegeben)[5]:

| SDG | NN (L) Health & Well-being (Exposure gegenüber SDG) | NN (L) Climate & Environment (Exposure gegenüber SDG) | NN (L) Smart Connectivity (Exposure gegenüber SDG) | NN (L) Global Equity Impact Opportunities (Exposure gegenüber SDG) |
|---|---|---|---|---|
| SDG 1: Keine Armut | 23% | | | 12% |
| SDG 2: Kein Hunger | 15% | 7% | | 5% |
| SDG 3: Gesundheit und Wohlergehen | 43% | | | 21% |
| SDG 4: Hochwertige Bildung | 6% | | | 2% |
| SDG 6: Sauberes Wasser und Sanitäreinrichtungen | 13% | 20% | | 10% |
| SDG 7: Bezahlbare und saubere Energie | | 28% | | 10% |
| SDG 8: Menschwürdige Arbeit und Wirtschaftswachstum | | | 38% | 16% |
| SDG 9: Industrie, Innovation und Infrastruktur | | 18% | 17% | 8% |
| SDG 10: Weniger Ungleichheiten | | | 26% | 6% |
| SDG 11: Nachhaltige Städte und Gemeinden | | | 7% | 2% |
| SDG 12: Nachhaltige/r Konsum und Produktion | | 15% | | 1% |
| SDG 13: Maßnahmen zum Klimaschutz | | 12% | | 3% |
| SDG 16: Frieden, Gerechtigkeit und starke Institutionen | | | 9% | 2% |
| SDG 17: Partnerschaften zur Erreichung der Ziele | | | 3% | 2% |

**Nachhaltigkeitsfonds**

Die Nachhaltigkeitsfonds haben in Unternehmen mit nachhaltigen Geschäftsmodellen investiert. Dabei handelt es sich in der Regel um Unternehmen, die eine nachhaltige Wertschöpfung erzielen, indem sie nachhaltige Lösungen anbieten, nachhaltiges Verhalten an den Tag legen und über eine nachhaltige Wettbewerbsposition verfügen.

Neben der Politik von NN IP für verantwortungsbewusstes Investieren und der Ausschlussliste wandten die Nachhaltigkeitsfonds die normenbasierten Kriterien für verantwortungsbewusste Anlagen der Verwaltungsgesellschaft an. Diese Ausschlussfilter beziehen sich auf Aktivitäten und Verhaltensweisen. Emittenten, bei denen gravierende und strukturelle Probleme im Hinblick auf ESG-Kontroversen bestanden, wurden ausgeschlossen.

Da die Fonds Impact-Anlageziele verfolgen, bestanden für Anlagen bei diesen Emittenten, einschließlich jener, die an Aktivitäten beteiligt sind, die einen Bezug zu Glücksspiel, Waffen, Erwachsenenunterhaltung, Pelze und Spezialleder, Bohrungen in der Arktis sowie Schieferöl und -gas aufweisen, strengere Einschränkungen.

Zur Messung der nachhaltigkeitsbezogenen Gesamtwirkung der Fonds wurden die Kohlenstoffintensität und die ESG Scores berücksichtigt. Diese Messwerte werden auf monatlicher Basis erfasst.

[5] Weitere Informationen sind auf der Website nnip.com zu finden.

# Bericht des Verwaltungsrats (Fortsetzung)

Die folgenden Fonds schneiden anhand dieser Indikatoren wie folgt ab (Stand: 30. September 2021)[6]:

| Bezeichnung des Fonds | Kohlenstoffintensität (Scope 1+2 und 3 ($tCO_2e$/1 Mio. Euro Umsatz)) | ESG Score (ESG Lens) | ESG Score (ESG-Risikorating von Sustainalytics) |
|---|---|---|---|
| NN (L) Global Sustainable Equity | 154,50 | 61,80 | 17,79 |
| NN (L) European Sustainable Equity | 253,35 | 64,23 | 18,47 |
| NN (L) Euro Sustainable Credit | 511,61 | 57,22 | 20,31 |
| NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials) | 765,80 | 58,82 | 19,68 |

[6] Weitere Informationen sind auf der Website nnip.com zu finden.

**Enhanced-Fonds**

Die Enhanced-Fonds weisen Unternehmen auf, die anhand mehrerer Kriterien aus den Bereichen Umwelt, Soziales und Unternehmensführung (ESG) geprüft wurden. Die Fonds weisen Zielunternehmen auf, welche die Beachtung sozialer Grundsätze (z.B. Menschenrechte, Nichtdiskriminierung, das Problem der Kinderarbeit) und ökologischer Prinzipien mit der finanziellen Performance vereinen.

Neben der Politik von NN IP für verantwortungsbewusstes Investieren und der Ausschlussliste wandten die Fonds die normenbasierten Kriterien für verantwortungsbewusste Anlagen der Verwaltungsgesellschaft an. Diese Ausschlussfilter beziehen sich auf Aktivitäten und Verhaltensweisen. Emittenten, bei denen gravierende und strukturelle Probleme im Hinblick auf ESG-Kontroversen bestanden, wurden ausgeschlossen.

Da die Fonds Impact-Anlageziele verfolgen, bestanden für Anlagen bei diesen Emittenten, einschließlich jener, die an Aktivitäten beteiligt sind, die einen Bezug zu Glücksspiel, Waffen, Erwachsenenunterhaltung, Pelze und Spezialleder, Bohrungen in der Arktis sowie Schieferöl und -gas aufweisen, strengere Einschränkungen.

Zur Messung der nachhaltigkeitsbezogenen Gesamtwirkung der Fonds wurden die Kohlenstoffintensität und die ESG Scores berücksichtigt. Diese Messwerte werden auf monatlicher Basis erfasst.

Die folgenden Fonds schneiden anhand dieser Indikatoren wie folgt ab (Stand: 30. September 2021)[7]:

| Bezeichnung des Fonds | Kohlenstoffintensität (Scope 1+2 und 3 ($tCO_2e$/1 Mio. Euro Umsatz)) | ESG Score (ESG Lens) | ESG Score (ESG-Risikorating von Sustainalytics) |
|---|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity | 1091,20 | 52,56 | 25,10 |
| NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity | 404,10 | 62,23 | 19,53 |
| NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity | 390,88 | 56,98 | 20,45 |
| NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity | 410,67 | 57,98 | 20,44 |

[7] Weitere Informationen sind auf der Website nnip.com zu finden.

**Luxemburg, 9. Dezember 2021**

**KPMG Luxembourg, Société coopérative**
39, Avenue John F. Kennedy
L-1855 Luxemburg

Tel.: +352 22 51 51 1
Fax: +352 22 51 71
E-Mail: info@kpmg.lu
Internet:
www.kpmg.lu

**Erstellt für die Anteilsinhaber der NN (L)**
**80, route d'Esch**
**L-1470 Luxemburg**

# BERICHT DES ABSCHLUSSPRÜFERS („réviseur d'entreprises agréé")

***Bericht über die Abschlussprüfung***

***Prüfungsurteil***

Wir haben die Abschlüsse von NN (L) und jedes ihrer Teilfonds (der „Fonds"), zu denen die Nettovermögensaufstellung, die Aufstellung des Wertpapierbestands und der derivativen Finanzinstrumente zum 30. September 2021 sowie die Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt zu Ende gegangene Geschäftsjahr und die Erläuterungen zum Jahresabschluss, einschließlich einer Zusammenfassung der wesentlichen Rechnungslegungsgrundsätze, gehören, geprüft.

Nach unserer Auffassung vermitteln die beigefügten Abschlüsse ein den tatsächlichen Verhältnissen entsprechendes Bild der Finanzlage der NN (L) und jedes ihrer Teilfonds zum 30. September 2021 sowie der Ertragslage und der Entwicklung ihres Nettovermögens für das zu diesem Zeitpunkt zu Ende gegangene Geschäftsjahr in Übereinstimmung mit den in Luxemburg für die Erstellung und Darstellung von Abschlüssen geltenden gesetzlichen und regulatorischen Bestimmungen.

***Grundlage des Prüfungsurteils***

Wir haben unsere Prüfung in Übereinstimmung mit dem Gesetz vom 23. Juli 2016 über den Beruf des Abschlussprüfers („Gesetz vom 23. Juli 2016") und mit den von der „Commission de Surveillance du Secteur Financier" („CSSF") für Luxemburg verabschiedeten internationalen Grundsätzen zur Abschlussprüfung (International Standards on Auditing, „ISA") durchgeführt. Unsere Verantwortlichkeiten gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den für Luxemburg von der CSFF verabschiedeten ISA werden im Einzelnen im Abschnitt „Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers ('réviseur d'entreprises agréé') für die Prüfung der Finanzabschlüsse" in unserem Bericht beschrieben. Wir sind außerdem unabhängig vom Fonds gemäß dem von der CSSF für Luxemburg verabschiedeten International Code of Ethics for Professional Accountants des International Ethics Standards Board for Accountants, der die International Independence Standards umfasst, („IESBA-Kodex") in Verbindung mit den für unsere Abschlussprüfung relevanten Standesregeln, und wir haben unsere sonstigen ethischen Verpflichtungen gemäß diesen Standesregeln erfüllt. Nach unserer Auffassung haben wir ausreichende und geeignete Prüfungsnachweise als Grundlage für unser Prüfungsurteil erlangt.

***Sonstige Informationen***

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die sonstigen Informationen. Die sonstigen Informationen umfassen die im Jahresbericht enthaltenen Informationen, nicht jedoch die Finanzabschlüsse und unseren diesbezüglichen Bericht des Abschlussprüfers („réviseur d'entreprises agréé").

Unser Prüfungsurteil zu den Finanzabschlüssen erstreckt sich nicht auf die sonstigen Informationen, und wir geben zu diesen keinerlei Bestätigung ab.

Unsere Aufgabe im Zusammenhang mit unserer Abschlussprüfung besteht darin, die sonstigen Informationen zu lesen und dabei abzuwägen, ob die sonstigen Informationen in wesentlichem Widerspruch zu den Finanzabschlüssen oder zu den Kenntnissen stehen, die wir im Rahmen unserer Prüfung erlangt haben, oder ob sie anderweitig offenkundig wesentliche unzutreffende Angaben enthalten. Wenn wir aufgrund unserer durchgeführten Arbeiten zu dem Schluss kommen, dass diese sonstigen Informationen wesentliche unzutreffende Angaben enthalten, müssen wir darüber berichten. Wir haben diesbezüglich nichts zu berichten.

KPMG Luxemburg, Genossenschaft, eine Gesellschaft nach luxemburgischem Recht und
Mitglied des KPMG-Netzwerks unabhängiger Mitgliedsfirmen
ein verbundenes Unternehmen von KPMG International Cooperative („KPMG International"),
einem Schweizer Unternehmen.

MwSt.. LU 27351518
R.C.S. Luxemburg B 149133

# BERICHT DES ABSCHLUSSPRÜFERS („réviseur d'entreprises agréé“) (Fortsetzung)

***Verantwortung des Verwaltungsrats des Fonds für die Finanzabschlüsse***

Der Verwaltungsrat des Fonds ist verantwortlich für die Erstellung und die angemessene Darstellung dieser Finanzabschlüsse in Übereinstimmung mit den in Luxemburg geltenden gesetzlichen und regulatorischen Bestimmungen hinsichtlich der Erstellung und Darstellung von Abschlüssen und für die aus Sicht des Verwaltungsrats des Fonds erforderlichen internen Kontrollsysteme im Hinblick auf die Erstellung von Abschlüssen, die frei sind von wesentlichen unzutreffenden Angaben, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Irrtum zurückzuführen sind.

Der Verwaltungsrat des Fonds ist dafür verantwortlich, bei der Erstellung der Finanzabschlüsse zu beurteilen, ob der Fonds und jeder seiner Teilfonds in der Lage ist, seine Geschäftstätigkeit fortzuführen, und gegebenenfalls Angelegenheiten in Bezug auf die Fortführung der Geschäftstätigkeit zu nennen und bei der Rechnungslegung von der Fortführung der Geschäftstätigkeit auszugehen, es sei denn, der Verwaltungsrat des Fonds beabsichtigt, den Fonds oder einen seiner Teilfonds zu liquidieren oder seinen Betrieb einzustellen, oder hat keine realistische Alternative dazu.

***Verantwortlichkeiten des Abschlussprüfers („réviseur d'entreprises agrée“) für die Abschlussprüfung***

Die Ziele unserer Prüfung bestehen darin, uns angemessen zu vergewissern, dass die Finanzabschlüsse insgesamt frei von wesentlichen unzutreffenden Angaben sind, unabhängig davon, ob diese auf Betrug oder Irrtum zurückzuführen sind, und einen Bericht des Abschlussprüfers („réviseur d'entreprises agréé“) mit unserem Prüfungsurteil herauszugeben. „Angemessen vergewissern“ bedeutet, ein hohes Maß an Sicherheit zu erlangen. Dies stellt jedoch keine Garantie dafür dar, dass im Rahmen einer gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg verabschiedeten ISA durchgeführten Prüfung wesentliche unzutreffende Angaben immer erkannt werden, wenn sie vorhanden ist. Unzutreffende Angaben können durch Betrug oder Irrtum entstehen und werden als wesentlich betrachtet, wenn nach billigem Ermessen davon auszugehen ist, dass sie einzeln oder zusammengenommen die wirtschaftlichen Entscheidungen beeinflussen könnten, die Leser auf Basis dieses Abschlusses treffen.

Im Rahmen einer Abschlussprüfung gemäß dem Gesetz vom 23. Juli 2016 und den von der CSSF für Luxemburg verabschiedeten ISA bilden wir uns während der gesamten Prüfung sachverständige Urteile und gehen mit kritischer Distanz vor. Darüber hinaus:

- identifizieren und beurteilen wir die Risiken wesentlicher unzutreffender Angaben in den Finanzabschlüssen aufgrund von Betrug oder Irrtum, konzipieren Prüfverfahren, die für diese Risiken angemessen sind, und wenden diese an und erlangen Prüfnachweise, die ausreichend geeignet sind, um uns ein Urteil zu bilden. Das Risiko, dass wesentliche unzutreffende Angaben aufgrund von Betrug nicht festgestellt werden, ist höher als bei unzutreffenden Angaben aufgrund von Fehlern, da Betrug mit geheimen Absprachen, Fälschung, absichtlichen Auslassungen, falschen Darstellungen oder dem Umgehen interner Kontrollen verbunden sein kann.
- gewinnen wir ein Verständnis von den internen Kontrollen, die für die Prüfung maßgeblich sind, um Prüfverfahren zu konzipieren, die unter den gegebenen Umständen geeignet sind, nicht aber zum Zweck eines Urteils über die Effektivität der internen Kontrollen des Fonds.
- evaluieren wir die Eignung der angewandten Rechnungslegungsgrundsätze und die Angemessenheit von Schätzungen und damit verbundenen Angaben seitens des Verwaltungsrats des Fonds.
- ziehen wir Schlüsse bezüglich der Angemessenheit der Anwendung der Basis der fortgeführten Geschäftstätigkeit durch den Verwaltungsrat und, auf Basis der erhaltenen Prüfnachweise, bezüglich des Vorliegens wesentlicher Unsicherheiten in Bezug auf Ereignisse oder Umstände, die erhebliche Zweifel an der Fähigkeit des Fonds oder eines seiner Teilfonds, seine Geschäfte fortzuführen, wecken könnten. Wenn wir zu dem Schluss kommen, dass eine wesentliche Unsicherheit besteht, sind wir verpflichtet, in unserem Bericht des Abschlussprüfers („réviseur d'entreprises agréé“) auf die betreffenden Angaben im Abschluss hinzuweisen, bzw. wenn diese Angaben unzureichend sind, unseren Prüfvermerk zu ändern. Unsere Schlussfolgerungen basieren auf den Prüfnachweisen, die wir bis zum Datum unseres Berichts des Abschlussprüfers („réviseur d'entreprises agréé“) eingeholt haben. Zukünftige Ereignisse oder Umstände können jedoch den Fonds oder einen seiner Teilfonds veranlassen, die Geschäftstätigkeit nicht fortzuführen.
- evaluieren wir die Gesamtdarstellung, die Struktur und den Inhalt der Finanzabschlüsse, einschließlich der Angaben, und prüfen, ob die Art und Weise der Darstellung der zu Grunde liegenden Transaktionen und Ereignisse in den Finanzabschlüssen angemessen ist.

# BERICHT DES ABSCHLUSSPRÜFERS („réviseur d'entreprises agréé“) (Fortsetzung)

Wir kommunizieren mit den für die Unternehmensführung verantwortlichen Personen, unter anderem über den Umfang und die zeitliche Planung der Prüfung sowie über wesentliche Ereignisse der Prüfung, einschließlich wesentlicher Mängel in der internen Kontrolle, die der Prüfer im Rahmen der Prüfung feststellt.

Darüber hinaus geben wir gegenüber den für die Überwachung Verantwortlichen eine Erklärung ab, dass wir die relevanten ethischen Anforderungen in Bezug auf die Unabhängigkeit eingehalten haben, und erörtern mit ihnen alle Beziehungen und sonstigen Sachverhalte, von denen vernünftigerweise angenommen werden kann, dass sie sich auf unsere Unabhängigkeit auswirken, und die hierzu getroffenen Schutzmaßnahmen.

**Luxemburg, 23. Dezember 2021**

**KPMG Luxembourg**
**Société coopérative**
**Cabinet de révision agréé**

**R. Beegun**
**Partner**

# Konsolidierte Abschlüsse

*(ausgedrückt in EUR)*

## Konsolidierte Aufstellung des Nettovermögens zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **35.698.423.925,94** |
| Aktien | | 11.646.834.936,64 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 991.208.116,53 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | 4.633.597,59 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 22.605.982.321,80 |
| Geldmarktinstrumente | | 449.764.953,38 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **92.539.339,35** |
| Rohstoff-Swaps | | 4.976.280,52 |
| Credit Default Swaps | | 44.526.197,32 |
| Zinsswaps | | 3.917.041,27 |
| Total Return Swaps | | 6.494.218,99 |
| Devisentermingeschäfte | | 2.106.632,61 |
| Futures | | 30.370.777,12 |
| Optionsscheine und Bezugsrechte | | 148.191,52 |
| **Bankguthaben** | | **1.263.045.059,87** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **128.976.717,00** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **1.681.684.777,61** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***38.864.669.819,77*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(22.175.199,02)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(1.403.097.842,06)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(245.670.700,84)** |
| Credit Default Swaps | | (3.191.095,35) |
| Zinsswaps | | (2.941.823,92) |
| Index-Futures | | (764.505,23) |
| Devisentermingeschäfte | | (230.130.886,70) |
| Optionen | | (129.692,56) |
| Futures | | (8.512.697,08) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(1.670.943.741,92)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***37.193.726.077,85*** |

## Konsolidierte Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **904.921.033,00** |
| Dividenden | | 174.170.447,10 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 709.904.775,91 |
| Bankzinsen | | 924.612,87 |
| Zinsen auf Swaps | | 11.717.950,39 |
| Sonstige Erträge | 10 | 8.203.246,73 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(341.452.789,73)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (223.786.104,10) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (80.367.663,71) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (1.901.701,07) |
| Abonnementsteuer | 9 | (8.671.368,90) |
| Bankzinsen | | (2.876.932,21) |
| Zinsen auf Swaps | | (10.012.028,08) |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | (13.762.656,93) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (74.334,73) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **563.468.243,27** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 2.404.650.354,59 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (689.339.609,36) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 1.273.774.423,33 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.108.006.744,08) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 128.399.961,27 |

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (127.230.427,06) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 829.018.162,64 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 1.634.925,50 |
| **Ergebnis** | | **3.276.369.290,10** |
| Zeichnungen | | 19.132.748.476,05 |
| Rücknahmen | | (17.265.437.625,46) |
| Ausschüttung | | (739.456.103,44) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 32.616.770.873,46 |
| Umrechnungsdifferenz | 2 | 172.731.167,14 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***37.193.726.077,85*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) AAA ABS

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 601.745.282,94 |
| | 30.09.2020 | EUR | 385.477.440,52 |
| | 30.09.2019 | EUR | 389.470.421,56 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.098,50 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.071,48 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.053,68 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.025,62 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.208,41 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.170,88 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.142,94 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 254.102,41 |
| | 30.09.2020 | EUR | 252.145,27 |
| | 30.09.2019 | EUR | 250.657,75 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 44.459 |
| | 30.09.2020 | | 2.775 |
| | 30.09.2019 | | 2.766 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | | 914 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 18.066 |
| | 30.09.2020 | | 18.667 |
| | 30.09.2019 | | 19.879 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | | 1.090 |
| | 30.09.2020 | | 1.090 |
| | 30.09.2019 | | 1.090 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,26% |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | | 0,28% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,06% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | | 0,01% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 68,91% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) AAA ABS

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **623.877.124,11** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 50.443.457,04 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 573.433.667,07 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **87.673,18** |
| Devisentermingeschäfte | | 87.673,18 |
| **Bankguthaben** | | **5.219.544,92** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **12.742.888,60** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***641.927.230,81*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(1.135,66)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(40.180.812,21)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(40.181.947,87)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***601.745.282,94*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **2.542.448,87** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 2.542.448,87 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(337.945,34)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (101.613,64) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (149.590,03) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (362,64) |
| Abonnementsteuer | 9 | (46.155,56) |
| Bankzinsen | | (40.223,47) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **2.204.503,53** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 2.385.490,49 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (417.643,77) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 8.645.153,43 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (15.199.442,95) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 951.523,96 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (748.629,72) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 5.224.452,24 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (21.192,82) |
| **Ergebnis** | | **3.024.214,39** |
| Zeichnungen | | 218.885.131,70 |
| Rücknahmen | | (5.641.503,67) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 385.477.440,52 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***601.745.282,94*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) AAA ABS

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 5.354.714 | ATLAS FUNDING 2021-1 PLC 2021-1 A 25/07/2058 FRN | GBP | 6.266.386,40 | 1,04 |
| 3.044.603 | CASTELL 2018-1 PLC 2018-1 A 25/01/2046 FRN | GBP | 3.546.285,37 | 0,59 |
| 5.646.498 | CASTELL 2019-1 PLC 2019-1 A 15/07/2052 FRN | GBP | 6.597.102,81 | 1,10 |
| 3.628.034 | CASTELL 2020 25/09/2052 FRN | GBP | 4.249.953,59 | 0,71 |
| 3.000.000 | CHESTER B1 ISSUER PLC B1 B 17/04/2023 FRN | GBP | 3.511.032,66 | 0,58 |
| 6.642.758 | DOWSON 2021-1 PLC A 20/03/2028 FRN | GBP | 7.758.909,77 | 1,29 |
| 14.000.000 | E-CARAT 12 PLC 12 A 18/08/2029 FRN | GBP | 16.318.144,90 | 2,71 |
| 3.584.102 | EUROSAIL 2006-1 PLC 2006-1X B1C 10/06/2044 FRN | GBP | 4.099.688,16 | 0,68 |
| 1.714.644 | EUROSAIL 2006-4NP PLC 2006-4X M1C 10/12/2044 FRN | GBP | 1.974.254,18 | 0,33 |
| 3.663.810 | FINSBURY SQUARE 2020-2 PLC 2020-2X 16/06/2070 FRN | GBP | 4.302.092,69 | 0,71 |
| 10.825.752 | FINSBURY SQUARE 2021-1GRX AGRN 16/12/2067 FRN | GBP | 12.648.172,14 | 2,10 |
| 774.912 | GREAT HALL MORTGAGES NO 1 PLC 2006-1 A2B 18/06/2038 FRN | EUR | 769.580,27 | 0,13 |
| 3.936.086 | HOPS HILL NO 1 PLC -1 A 27/05/2054 FRN | GBP | 4.619.790,48 | 0,77 |
| 5.000.000 | LANEBROOK MORTGAGE TRANSACTION 2021 2021-1 A 20/07/2058 FRN | GBP | 5.825.298,58 | 0,97 |
| 2.917.000 | NEWDAY FUNDING MASTER ISSUER PLC - SERIES 2021-1X A1 15/03/2024 FRN | GBP | 3.411.286,40 | 0,57 |
| 3.500.000 | NEWDAY FUNDING 2019-1X A PLC 15/06/2027 FRN | GBP | 4.089.175,47 | 0,68 |
| 2.985.460 | POLARIS 2021-1 PLC 2021-1 A 23/12/2058 FRN | GBP | 3.485.271,48 | 0,58 |
| 3.367.163 | RESIDENTIAL MORTGAGE SECURITIES 32 PLC 32X A 20/06/2070 FRN | GBP | 3.956.033,52 | 0,66 |
| 6.477.634 | RIPON MORTGAGES PLC 1X A2 20/08/2056 FRN | GBP | 7.547.424,58 | 1,25 |
| 7.036.000 | RIPON 1X B2 20/02/2022 FRN | GBP | 8.205.484,94 | 1,36 |
| 3.146.791 | SHAWBROOK MORTGAGE FUNDING 2019-1 PLC 2019-1 A 16/12/2050 FRN | GBP | 3.676.592,03 | 0,61 |
| 18.000.000 | STRATTON MORTGAGE FUNDING 2021-3 PLC 2021-3 A 12/06/2024 FRN | GBP | 20.933.843,81 | 3,49 |
| 2.506.805 | TOGETHER ASSET BACKED SECURITISATION 2018-1A 12/07/2050 FRN | GBP | 2.927.683,27 | 0,49 |
| 3.235.995 | TOGETHER ASSET BACKED SECURITISATION 2019-1 PLC 2019-1 A 15/07/2061 FRN | GBP | 3.788.515,76 | 0,63 |
| 3.844.301 | TOWD POINT MORTGAGE FUNDING PLC -2019-V2X A 20/02/2054 FRN | GBP | 4.493.617,69 | 0,75 |
| 3.506.335 | TOWER BRIDGE FUNDING NO 3 PLC -3 A 20/12/2061 FRN | GBP | 4.086.645,58 | 0,68 |
| 1.555.241 | TUDOR ROSE MORTGAGES 2020-1 PLC 2020-1 D 20/06/2048 FRN | GBP | 1.812.663,97 | 0,30 |
| 5.371.264 | TWIN BRIDGES 2021-1 PLC 2021-1 A 12/03/2026 FRN | GBP | 6.283.036,87 | 1,04 |
| 10.250.000 | TWIN BRIDGES 2021-2 PLC 2021-2 A 12/09/2026 FRN | GBP | 11.929.025,44 | 1,98 |
| | | | **173.112.992,81** | **28,78** |
| | **Irland** | | | |
| 700.000 | ALME LOAN FUNDING IV DAC 4X AR 15/01/2032 FRN | EUR | 700.013,72 | 0,12 |
| 2.500.000 | ALME LOAN FUNDING IV DAC 4X ARE 15/01/2032 FRN | EUR | 2.500.049,00 | 0,42 |
| 2.500.000 | AVOCA CLO XV DAC -15X AR 15/04/2031 FRN | EUR | 2.500.343,75 | 0,42 |
| 1.016.286 | BLUESTEP MORTGAGE SECURITIES NO 4 DAC -4 A 10/08/2066 FRN | EUR | 1.016.308,12 | 0,17 |
| 1.729.265 | CARLYLE GLOBAL MARKET STRATEGIES EURO CLO 2015-2 DAC 2015-2X AA1R 21/09/2029 FRN | EUR | 1.734.048,65 | 0,29 |
| 1.570.306 | CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2018-1 A 15/12/2027 FRN | EUR | 1.571.807,67 | 0,26 |
| 1.770.000 | CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2020-1 A 15/12/2029 FRN | EUR | 1.779.996,84 | 0,30 |
| 3.441.886 | DILOSK RMBS NO 3 DAC -3 A 20/10/2057 FRN | EUR | 3.447.528,51 | 0,57 |
| 2.311.176 | EOS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 35 DAC -35X A 23/04/2029 FRN | EUR | 2.315.489,27 | 0,38 |
| 3.875.000 | FASTNET SECURITIES 12 DAC -12 B 10/10/2056 FRN | EUR | 3.875.150,08 | 0,64 |
| 2.836.034 | FASTNET SECURITIES 13 DAC -13 A 18/04/2057 FRN | EUR | 2.840.552,71 | 0,47 |
| 3.951.680 | FINANCE IRELAND RMBS NO 1 DAC -1 A 24/06/2058 FRN | EUR | 3.957.872,00 | 0,66 |
| 7.068.509 | FINANCE IRELAND RMBS NO 2 DAC -2 A 24/09/2023 FRN | EUR | 7.093.899,83 | 1,18 |
| 6.182.945 | FINGAL SECURITIES RMBS DAC -1 A 28/07/2055 FRN | EUR | 6.219.916,69 | 1,03 |
| 6.900.000 | FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 2021 DAC 2021 A 15/10/2030 FRN | EUR | 6.925.461,00 | 1,15 |
| 8.800.000 | FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 2021 DAC 2021 B 15/10/2030 FRN | EUR | 8.800.000,00 | 1,46 |
| 9.810.391 | GLENBEIGH 2 ISSUER DAC -1X A 24/03/2046 FRN | EUR | 9.816.825,83 | 1,63 |
| 12.100.000 | GLENBEIGH 2 ISSUER 2021-2 DAC 2021-2X A 24/12/2024 FRN | EUR | 12.168.273,89 | 2,02 |
| 2.500.000 | GOLDENTREE LOAN MANAGEMENT EUR CLO 1 DAC -1X A1A 20/10/2030 FRN | EUR | 2.494.567,75 | 0,41 |
| 4.033.000 | HARVEST CLO VIII DAC -8X ARR 15/01/2031 FRN | EUR | 4.007.188,80 | 0,67 |
| 9.050.000 | HARVESTO XXII DAC 22X A 15/01/2032 FRN | EUR | 9.053.981,10 | 1,50 |
| 6.300.000 | HENLEY CLO III DAC -3X A 25/01/2034 FRN | EUR | 6.306.604,29 | 1,05 |
| 10.585.650 | MULCAIR SECURITIES DAC -1 A 24/04/2071 FRN | EUR | 10.613.028,81 | 1,76 |
| 1.910.005 | ORANJE EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 32 DAC -32 A 22/11/2028 FRN | EUR | 1.914.785,33 | 0,32 |
| 12.535.226 | PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 A 24/03/2061 FRN | EUR | 12.546.733,45 | 2,09 |
| 2.532.209 | TAURUS 2019-1 FR DAC 2019-1FR A 02/02/2031 FRN | EUR | 2.531.171,51 | 0,42 |
| 1.105.000 | TAURUS 2019-4 FIN DAC 2019-FIN4 A 18/11/2031 FRN | EUR | 1.106.945,23 | 0,18 |
| 3.712.041 | TAURUS 2020-1 NL DAC 2020-NL1X A 20/02/2030 FRN | EUR | 3.719.154,93 | 0,62 |
| 6.000.000 | VOYA EUROO I DAC 1X A 15/04/2020 FRN | EUR | 6.000.469,80 | 1,00 |
| | | | **139.558.168,56** | **23,19** |
| | **Niederlande** | | | |
| 13.710.765 | BUMPER NL 2020-1 BV -2020-NL1 A 24/06/2031 FRN | EUR | 13.837.859,13 | 2,30 |
| 4.392.111 | DELFT 2020 BV 2020-1 A 17/10/2042 FRN | EUR | 4.392.507,32 | 0,73 |
| 9.747.388 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2017-1 BV 2017-1 A 28/01/2048 FRN | EUR | 9.766.657,82 | 1,62 |
| 8.847.197 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2018-1 BV 2018-1 A 28/04/2051 FRN | EUR | 8.859.460,05 | 1,47 |
| 3.014.318 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2019-1 BV 2019-1 A 28/10/2052 FRN | EUR | 3.023.705,61 | 0,50 |
| 4.409.243 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2020-1 BV 2020-1 A 28/07/2054 FRN | EUR | 4.423.147,87 | 0,74 |
| 1.000.000 | GLDR 2019-A 20/10/2027 FRN | EUR | 1.002.198,93 | 0,17 |
| 19.800.000 | GREEN APPLE 2021-I BV 2021-1 A 17/07/2028 FRN | EUR | 20.340.933,43 | 3,37 |
| 4.600.000 | GREEN STORM 2021 BV 2021-GRN A 22/02/2068 FRN | EUR | 4.728.375,83 | 0,79 |
| 7.832.470 | JUBILEE CLO 2015-XVI BV 2015-16X A1R 15/12/2029 FRN | EUR | 7.797.406,87 | 1,30 |
| 9.100.000 | SILVER ARROW ATHLON NL 2021-1 BV 2021-1 A 26/02/2025 FRN | EUR | 9.174.125,60 | 1,52 |
| 5.972.550 | TULIP MORTGAGE FUNDING 2019-1 BV 2019-1 A 18/10/2056 FRN | EUR | 5.996.335,20 | 1,00 |
| | | | **93.342.713,66** | **15,51** |
| | **Frankreich** | | | |
| 19.500.000 | AUTO ABS FRENCH LEASES 2021 FCT 2021-FR1 A 29/03/2025 FRN | EUR | 19.696.562,93 | 3,27 |
| 7.017.810 | BPCE HOME LOANS FCT 2020 2020-1 A 31/10/2054 FRN | EUR | 7.113.041,49 | 1,18 |
| 1.869.678 | BUMPER 10 FCT 10 B 27/02/2028 FRN | EUR | 1.870.115,07 | 0,31 |
| 3.126.276 | CFHL-1 2014 2014-1 B 28/04/2054 FRN | EUR | 3.132.450,18 | 0,52 |
| 7.400.000 | FCT CREDIT AGRICOLE HABITAT 2020 2020-1 A 27/07/2055 FRN | EUR | 7.534.123,89 | 1,25 |
| 6.043.913 | HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 2019-1 A 27/11/2024 FRN | EUR | 6.113.151,79 | 1,02 |
| 4.721.606 | HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 2020-2 2020-2 A 27/10/2020 FRN | EUR | 4.780.756,57 | 0,79 |
| 20.900.000 | HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 2021-1 2021-1 A 27/05/2061 FRN | EUR | 21.182.582,21 | 3,53 |
| 3.741.225 | SILVER ARROW SA 2020-1FR A 21/11/2022 FRN | EUR | 3.749.313,52 | 0,62 |
| | | | **75.172.097,65** | **12,49** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) AAA ABS

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Luxemburg** | | | |
| 5.446.606 | BUMP 2019-D 22/11/2022 FRN | EUR | 5.462.135,34 | 0,91 |
| 4.198.495 | CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGES BLUE SA BLUE A 18/07/2044 FRN | EUR | 4.217.867,78 | 0,70 |
| 5.881.500 | CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGES 4 SA -4 A 25/11/2054 FRN | EUR | 5.919.274,46 | 0,98 |
| 7.185.938 | FACT MASTER SA 2021-1 A 20/07/2028 FRN | EUR | 7.240.917,44 | 1,20 |
| 5.617.967 | MIRAVET SARL - COMPARTMENT 2020-1 2020-1 A 26/05/2065 FRN | EUR | 5.631.455,38 | 0,94 |
| 12.201.757 | MIRAVET SARL 2019-1 A 26/05/2065 FRN | EUR | 12.215.096,57 | 2,04 |
| | | | **40.686.746,97** | **6,77** |
| | **Spanien** | | | |
| 7.800.000 | AUTONORIA SPAIN 2021 FT 2021-SP A 31/01/2039 FRN | EUR | 7.887.114,30 | 1,30 |
| 5.422.138 | DRIVER ESPANA SIX FT -6 A 25/09/2030 FRN | EUR | 5.447.350,70 | 0,91 |
| 6.854.138 | FONDO DE TITULIZACION RMBS PRADO V 5 A 15/03/2055 FRN | EUR | 6.870.291,08 | 1,14 |
| 7.100.000 | FT RMBS PRADO VIII 8 A 15/06/2026 FRN | EUR | 7.196.821,99 | 1,20 |
| | | | **27.401.578,07** | **4,55** |
| | **Belgien** | | | |
| 11.000.000 | BUMPER BE NV/SA 2021-BE1 A 23/10/2031 FRN | EUR | 11.077.110,00 | 1,84 |
| | | | **11.077.110,00** | **1,84** |
| | **Australien** | | | |
| 2.115.682 | LIBERTY FUNDING PTY LTD 2018-1 A1C 10/10/2049 FRN | EUR | 2.115.879,33 | 0,35 |
| 1.899.439 | LIBERTY SERIES 2017-4 2017-4 A1C 25/04/2049 FRN | EUR | 1.899.757,43 | 0,32 |
| 4.029.979 | PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST NO 22 22X A1GE 20/06/2060 FRN | EUR | 3.870.141,12 | 0,64 |
| 1.213.740 | PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST NO 25 25X A1GE 12/03/2061 FRN | EUR | 1.207.438,76 | 0,20 |
| | | | **9.093.216,64** | **1,51** |
| | **Italien** | | | |
| 3.955.975 | PELMO SRL 1 A 15/12/2036 FRN | EUR | 3.989.042,71 | 0,66 |
| | | | **3.989.042,71** | **0,66** |
| | | | **573.433.667,07** | **95,30** |

### Organismen für gemeinsame Anlagen

**Offene Fonds**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | **Luxemburg** | | | |
| 50.917 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 50.443.457,04 | 8,38 |
| | | | **50.443.457,04** | **8,38** |
| | | | **50.443.457,04** | **8,38** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **623.877.124,11** | **103,68** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 4.597.364,72 | USD | 3.874.659,38 | EUR | 19/10/2021 | 3.874.659,38 | 91.006,49 |
| 5.585,58 | EUR | 6.627,13 | USD | 19/10/2021 | 5.585,58 | (130,95) |
| 172.111.245,23 | EUR | 148.005.000,00 | GBP | 29/10/2021 | 172.111.245,23 | (3.202,36) |
| | | | | | **175.991.490,19** | **87.673,18** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **87.673,18** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **623.877.124,11** | **103,68** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **87.673,18** | **0,01** |
| **Bankguthaben** | **5.219.544,92** | **0,87** |
| **Bankverbindlichkeiten** | **(1.135,66)** | **0,00** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(27.437.923,61)** | **(4,56)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **601.745.282,94** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Alternative Beta

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 416.244.317,91 |
| | 30.09.2020 | USD | 366.351.090,65 |
| | 30.09.2019 | USD | 341.555.975,30 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 7.574,04 |
| | 30.09.2020 | USD | 6.531,82 |
| | 30.09.2019 | USD | 6.071,11 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 6.491,54 |
| | 30.09.2020 | CHF | 5.670,66 |
| | 30.09.2019 | CHF | 5.398,78 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.988,15 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.095,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.793,45 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 125,50 |
| | 30.09.2020 | GBP | 108,92 |
| | 30.09.2019 | GBP | 102,91 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 24.814,77 |
| | 30.09.2020 | PLN | 21.567,65 |
| | 30.09.2019 | PLN | 20.264,28 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 335,45 |
| | 30.09.2020 | EUR | 292,95 |
| | 30.09.2019 | EUR | 278,98 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 460,43 |
| | 30.09.2020 | EUR | 394,98 |
| | 30.09.2019 | EUR | 397,40 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 347,63 |
| | 30.09.2020 | USD | 301,72 |
| | 30.09.2019 | USD | 282,24 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 322,80 |
| | 30.09.2020 | EUR | 283,46 |
| | 30.09.2019 | EUR | 270,89 |
| Capitalisation R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 290,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 253,39 |
| | 30.09.2019 | EUR | 241,19 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 445,57 |
| | 30.09.2020 | EUR | 383,38 |
| | 30.09.2019 | EUR | 386,90 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 353,09 |
| | 30.09.2020 | USD | 307,39 |
| | 30.09.2019 | USD | 288,41 |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.419,24 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.558,33 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.240,46 |
| Distribution I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 12.173,76 |
| | 30.09.2020 | GBP | 10.582,57 |
| | 30.09.2019 | GBP | - |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 2.455 |
| | 30.09.2020 | 1.185 |
| | 30.09.2019 | 1.715 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 9.855 |
| | 30.09.2020 | 5.661 |
| | 30.09.2019 | 4.311 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 29.527 |
| | 30.09.2020 | 17.963 |
| | 30.09.2019 | 14.439 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 75.578 |
| | 30.09.2020 | 87.234 |
| | 30.09.2019 | 76.473 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 166 |
| | 30.09.2020 | 274 |
| | 30.09.2019 | 126 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 972 |
| | 30.09.2020 | 319 |
| | 30.09.2019 | 392 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 4.107 |
| | 30.09.2020 | 1.435 |
| | 30.09.2019 | 1.309 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 61.163 |
| | 30.09.2020 | 46.724 |
| | 30.09.2019 | 49.135 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 76.369 |
| | 30.09.2020 | 69.182 |
| | 30.09.2019 | 115.643 |
| Capitalisation R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1.409 |
| | 30.09.2020 | 710 |
| | 30.09.2019 | 710 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 29.409 |
| | 30.09.2020 | 10.386 |
| | 30.09.2019 | 10.052 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 3.256 |
| | 30.09.2020 | 1.372 |
| | 30.09.2019 | 1.068 |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 927 |
| | 30.09.2020 | 21.208 |
| | 30.09.2019 | 26.750 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Alternative Beta

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0.12 |
| | 30.09.2020 | 4 |
| | 30.09.2019 | - |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I Hedged (i) (GBP) | 14.12.2020 | GBP | 31,50 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,71% |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 0,73% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,73% |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,73% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,73% |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,87% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,35% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,35% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,37% |
| Capitalisation R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,87% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 1,65% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,65% |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,00% |
| Distribution I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,73% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (139,46%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Alternative Beta

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **76.082.561,02** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 87.401,57 |
| Geldmarktinstrumente | | 75.995.159,45 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **1.712.896,84** |
| Rohstoff-Swaps | | 1.712.896,84 |
| **Bankguthaben** | | **321.892.550,42** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **21.711.266,12** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **34.787.551,17** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***456.186.825,57*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(27.918.242,69)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(12.024.264,97)** |
| Index-Futures | | (886.023,32) |
| Devisentermingeschäfte | | (8.505.365,72) |
| Futures | | (2.632.875,93) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(39.942.507,66)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***416.244.317,91*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **593.296,65** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 45.995,57 |
| Bankzinsen | | 547.301,08 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(2.947.270,24)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.009.116,07) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (740.165,49) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (63.388,90) |
| Abonnementsteuer | 9 | (60.506,15) |
| Bankzinsen | | (67.591,56) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (6.502,07) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(2.353.973,59)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 3.235,00 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (2.530.087,70) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 78.483.846,36 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (25.128.203,33) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 1.692.371,26 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.268.880,50) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (13.608,23) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (5.187.482,29) |
| **Ergebnis** | | **43.697.216,98** |
| Zeichnungen | | 263.583.963,29 |
| Rücknahmen | | (257.387.801,24) |
| Ausschüttung | | (151,77) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 366.351.090,65 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***416.244.317,91*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Alternative Beta

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 10.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.500% 15/02/2045 | USD | 10.800,00 | 0,00 |
| 10.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 3.125% 15/11/2041 | USD | 11.910,94 | 0,01 |
| 10.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 5.250% 15/02/2029 | USD | 12.756,25 | 0,01 |
| 10.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 5.250% 15/11/2028 | USD | 12.700,00 | 0,00 |
| 10.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.125% 15/08/2029 | USD | 13.579,69 | 0,00 |
| 10.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.625% 15/02/2027 | USD | 12.910,94 | 0,00 |
| 10.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.750% 15/08/2026 | USD | 12.743,75 | 0,00 |
| | | | **87.401,57** | **0,02** |
| | | | **87.401,57** | **0,02** |
| **Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 25.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 03/03/2022 | USD | 24.995.868,25 | 6,01 |
| 13.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 07/10/2021 | USD | 12.999.949,30 | 3,12 |
| 23.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 14/10/2021 | USD | 22.999.835,55 | 5,53 |
| 15.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 18/11/2021 | USD | 14.999.506,35 | 3,60 |
| | | | **75.995.159,45** | **18,26** |
| | | | **75.995.159,45** | **18,26** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **76.082.561,02** | **18,28** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl | Bezeichnung | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|
| **Rohstoff-Swap** | | | | | |
| 441.912 | COMMODITY ENHANCED CURVE INDEX | 08/12/2021 | USD | 41.124.062,30 | 1.712.896,84 |
| | | | | | **1.712.896,84** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 18.866.131,98 | USD | 17.407.918,62 | CHF | 19/10/2021 | 18.866.131,98 | 197.922,54 |
| 1.963.171,48 | USD | 1.423.987,18 | GBP | 19/10/2021 | 1.963.171,48 | 43.101,61 |
| 2.213.930,74 | USD | 1.883.953,34 | EUR | 19/10/2021 | 2.213.930,74 | 29.877,58 |
| 79.017,77 | USD | 67.689,87 | EUR | 01/10/2021 | 79.017,77 | 568,60 |
| 42.282,47 | USD | 39.267,73 | CHF | 01/10/2021 | 42.282,47 | 188,10 |
| 29.038,59 | USD | 24.999,86 | EUR | 04/10/2021 | 29.038,59 | 65,00 |
| 2.099,41 | USD | 1.959,48 | CHF | 04/10/2021 | 2.099,41 | (1,10) |
| 13.971,88 | USD | 10.407,36 | GBP | 04/10/2021 | 13.971,88 | (60,89) |
| 185.623,57 | EUR | 215.611,06 | USD | 04/10/2021 | 215.611,06 | (482,63) |
| 4.095.665,10 | PLN | 1.077.661,30 | USD | 19/10/2021 | 1.077.661,30 | (46.355,46) |
| 11.025.794,62 | GBP | 15.200.776,64 | USD | 19/10/2021 | 15.200.776,64 | (333.861,85) |
| 82.183.146,48 | CHF | 89.984.321,17 | USD | 19/10/2021 | 89.984.321,17 | (1.851.315,48) |
| 241.901.031,14 | EUR | 286.979.086,98 | USD | 19/10/2021 | 286.979.086,98 | (6.545.011,74) |
| | | | | | **416.667.101,47** | **(8.505.365,72)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **INDEX FUTURES** | | | | |
| 17.088 | NDUEEGF INDEX 09/12/2021 | USD | 10.533.784,55 | (886.023,32) |
| | | | **10.533.784,55** | **(886.023,32)** |
| **Futures auf Aktienindizes** | | | | |
| (152) | CBOE VIX FUTURE 17/11/2021 | USD | 3.600.256,80 | (169.767,43) |
| (315) | CBOE VIX FUTURE 20/10/2021 | USD | 7.203.357,00 | (637.011,34) |
| 644 | E-MINI RUSSELL 2000 17/12/2021 | USD | 70.865.760,00 | (1.139.530,00) |
| 38 | EURO STOXX 50 17/12/2021 | EUR | 1.782.743,22 | (51.228,50) |
| 121 | FTSE 100 INDEX FUTURE 17/12/2021 | GBP | 11.540.439,61 | 87.813,95 |
| 37 | NASDAQ 100 E-MINI 17/12/2021 | USD | 10.865.050,00 | (552.975,00) |
| (222) | NIKKEI 225 (SGX) 09/12/2021 | JPY | 29.517.096,14 | 360.206,14 |
| (71) | S&P500 EMINI FUTURE 17/12/2021 | USD | 15.257.012,50 | 573.274,55 |
| | | | **150.631.715,27** | **(1.529.217,63)** |
| **Zins-Future** | | | | |
| 306 | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 40.272.468,75 | (503.002,30) |
| | | | **40.272.468,75** | **(503.002,30)** |
| **Währungs-Futures** | | | | |
| (346) | DOLLAR INDEX 13/12/2021 | USD | 32.607.040,00 | (600.656,00) |
| | | | **32.607.040,00** | **(600.656,00)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(10.311.368,13)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Alternative Beta

*(ausgedrückt in USD)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **76.082.561,02** | **18,28** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(10.311.368,13)** | **(2,48)** |
| **Bankguthaben** | **321.892.550,42** | **77,33** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **28.580.574,60** | **6,87** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **416.244.317,91** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asia Income

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 199.523.440,80 |
| | 30.09.2020 | USD | 191.165.705,07 |
| | 30.09.2019 | EUR | 210.833.575,59 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 14.074,79 |
| | 30.09.2020 | EUR | 11.858,67 |
| | 30.09.2019 | EUR | 11.165,15 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | - |
| | 30.09.2020 | PLN | 34.394,43 |
| | 30.09.2019 | PLN | 30.537,05 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 44,79 |
| | 30.09.2020 | EUR | 37,81 |
| | 30.09.2019 | EUR | 35,66 |
| Capitalisation O (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.551,88 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.322,85 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.157,78 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 520,30 |
| | 30.09.2020 | EUR | 442,95 |
| | 30.09.2019 | EUR | 421,40 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.493,30 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.286,35 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.137,73 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.355,26 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.173,14 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.042,68 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 687,96 |
| | 30.09.2020 | USD | 636,81 |
| | 30.09.2019 | USD | 610,47 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 242,60 |
| | 30.09.2020 | USD | 222,82 |
| | 30.09.2019 | USD | 211,91 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 226,79 |
| | 30.09.2020 | USD | 210,55 |
| | 30.09.2019 | USD | 203,37 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 224,51 |
| | 30.09.2020 | AUD | 212,57 |
| | 30.09.2019 | AUD | 214,88 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 232,42 |
| | 30.09.2020 | USD | 218,32 |
| | 30.09.2019 | USD | 213,23 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 1.352 |
| | 30.09.2020 | 1.443 |
| | 30.09.2019 | 1.698 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 916 |
| | 30.09.2019 | 806 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 492.313 |
| | 30.09.2020 | 495.883 |
| | 30.09.2019 | 634.797 |
| Capitalisation O (USD) | 30.09.2021 | 1.732 |
| | 30.09.2020 | 1.847 |
| | 30.09.2019 | 2.160 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1.299 |
| | 30.09.2020 | 1.806 |
| | 30.09.2019 | 2.228 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 48.130 |
| | 30.09.2020 | 51.792 |
| | 30.09.2019 | 54.167 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 6.537 |
| | 30.09.2020 | 4.565 |
| | 30.09.2019 | 7.017 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 5.044 |
| | 30.09.2020 | 5.482 |
| | 30.09.2019 | 5.625 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 3.863 |
| | 30.09.2020 | 4.733 |
| | 30.09.2019 | 5.325 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 168.218 |
| | 30.09.2020 | 133.056 |
| | 30.09.2019 | 145.169 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | 41.772 |
| | 30.09.2020 | 40.185 |
| | 30.09.2019 | 61.098 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 79.052 |
| | 30.09.2020 | 123.302 |
| | 30.09.2019 | 206.066 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 49,55 |
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 17,30 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,40 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asia Income

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 08.04.2021 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 06.10.2020 | USD | 1,40 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 08.04.2021 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 1,47 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 06.10.2020 | AUD | 1,47 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 08.04.2021 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,48 |
| Distribution Y (M) (USD) | 06.10.2020 | USD | 1,48 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,86% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation O (USD) | 30.09.2021 | 0,85% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,90% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,90% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,40% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,90% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,15% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,40% |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | 2,42% |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 3,40% |

**Portfolioumsatz in %*** 30.09.2021 9,35%

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asia Income

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **189.025.260,08** |
| Aktien | | 189.025.260,08 |
| **Bankguthaben** | | **5.105.591,74** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **2.606.762,13** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **5.796.832,60** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***202.534.446,55*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(2.439.479,55)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(571.526,20)** |
| Devisentermingeschäfte | | (82.435,00) |
| Optionen | | (124.498,36) |
| Futures | | (364.592,84) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(3.011.005,75)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***199.523.440,80*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **4.955.439,85** |
| Dividenden | | 4.949.924,75 |
| Bankzinsen | | 314,34 |
| Sonstige Erträge | 10 | 5.200,76 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(4.225.419,39)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (3.144.961,42) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (962.118,91) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (2.095,16) |
| Abonnementsteuer | 9 | (98.147,26) |
| Bankzinsen | | (12.444,10) |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | (2.116,10) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (3.536,44) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **730.020,46** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 45.928.387,60 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (16.350.159,08) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 19.351.606,23 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (15.650.315,85) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 1.181.378,39 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.091.406,28) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (2.930.908,11) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 808.621,68 |
| **Ergebnis** | | **31.977.225,04** |
| Zeichnungen | | 195.345.331,19 |
| Rücknahmen | | (213.692.653,49) |
| Ausschüttung | | (5.272.167,01) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 191.165.705,07 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***199.523.440,80*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asia Income

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 75.000 | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | TWD | 2.348.473,08 | 1,18 |
| 13.000 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR | USD | 1.924.650,00 | 0,96 |
| 50.000 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | HKD | 940.074,22 | 0,47 |
| 16.800 | JD.COM INC - A | HKD | 609.352,53 | 0,31 |
| 91.500 | JD.COM INC ADR | USD | 6.609.960,00 | 3,31 |
| 3.570.000 | KWG PROPERTY HOLDING LTD | HKD | 3.479.516,95 | 1,74 |
| 390.000 | LI NING CO LTD | HKD | 4.502.942,71 | 2,26 |
| 33.500 | SEA LTD ADR | USD | 10.677.455,00 | 5,35 |
| 15.000 | SILERGY CORP | TWD | 2.203.538,75 | 1,10 |
| 1.195.000 | SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD | HKD | 2.464.108,68 | 1,23 |
| 206.000 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 12.173.372,07 | 6,10 |
| 511.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD | HKD | 423.439,41 | 0,21 |
| 990.000 | TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 1.128.473,34 | 0,57 |
| 7.470.000 | WANT WANT CHINA HOLDINGS LTD | HKD | 5.635.104,15 | 2,83 |
| 125.000 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | HKD | 2.025.193,97 | 1,02 |
| | | | **57.145.654,86** | **28,64** |
| | **China** | | | |
| 220.000 | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD - H | HKD | 1.183.417,69 | 0,59 |
| 284.563 | BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 1.948.293,56 | 0,98 |
| 9.723.000 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP - H | HKD | 6.948.651,71 | 3,48 |
| 5.061.000 | CHINA MOLYBDENUM CO LTD - H | HKD | 3.143.722,49 | 1,58 |
| 113.800 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 9.242.325,05 | 4,63 |
| 435.000 | GREAT WALL MOTOR CO LTD - H | HKD | 1.598.958,67 | 0,80 |
| 11.405.000 | INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD - H | HKD | 6.324.836,64 | 3,18 |
| 420.900 | NARI TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 2.334.912,16 | 1,17 |
| 598.364 | WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD - A | CNH | 6.453.889,39 | 3,23 |
| 1.552.000 | ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD | HKD | 1.385.449,06 | 0,69 |
| | | | **40.564.456,42** | **20,33** |
| | **Taiwan** | | | |
| 181.000 | ASUSTEK COMPUTER INC | TWD | 2.108.365,20 | 1,06 |
| 4.585.000 | AU OPTRONICS CORP | TWD | 2.896.011,76 | 1,45 |
| 770.000 | HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD | TWD | 2.893.318,84 | 1,45 |
| 335.000 | KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP | TWD | 2.421.655,98 | 1,21 |
| 290.000 | MERIDA INDUSTRY CO LTD | TWD | 3.035.569,22 | 1,52 |
| 785.000 | NAN YA PLASTICS CORP | TWD | 2.570.437,36 | 1,29 |
| 198.000 | NOVATEK MICROELECTRONICS CORP | TWD | 2.905.128,30 | 1,46 |
| 1.887.000 | QUANTA COMPUTER INC | TWD | 5.233.471,65 | 2,62 |
| 399.000 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 8.281.655,49 | 4,15 |
| 200.000 | UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | TWD | 944.757,17 | 0,47 |
| 745.000 | UNITED MICROELECTRONICS CORP | TWD | 1.706.288,71 | 0,86 |
| | | | **34.996.659,68** | **17,54** |
| | **Südkorea** | | | |
| 23.000 | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | KRW | 3.437.792,57 | 1,72 |
| 118.000 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | KRW | 7.362.981,17 | 3,69 |
| 18.000 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD - PREF | KRW | 1.054.958,12 | 0,53 |
| 13.150 | SAMSUNG SDI CO LTD | KRW | 7.950.668,97 | 3,98 |
| 195.700 | SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | KRW | 6.657.722,13 | 3,34 |
| 25.500 | SK HYNIX INC | KRW | 2.211.723,74 | 1,11 |
| | | | **28.675.846,70** | **14,37** |
| | **Indien** | | | |
| 22.000 | BRITANNIA INDUSTRIES LTD | INR | 1.167.239,89 | 0,59 |
| 70.000 | HDFC BANK LTD | INR | 1.497.660,11 | 0,75 |
| 186.000 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD | INR | 6.857.970,87 | 3,43 |
| 105.000 | INFOSYS LTD | INR | 2.368.697,77 | 1,19 |
| 2.866 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | INR | 71.983,82 | 0,04 |
| | | | **11.963.552,46** | **6,00** |
| | **Hongkong** | | | |
| 410.000 | AIA GROUP LTD | HKD | 4.723.360,69 | 2,37 |
| 58.300 | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | HKD | 3.582.571,64 | 1,80 |
| 165.000 | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | HKD | 3.277.644,35 | 1,64 |
| | | | **11.583.576,68** | **5,81** |
| | **Indonesien** | | | |
| 7.310.000 | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | IDR | 3.131.714,55 | 1,57 |
| | | | **3.131.714,55** | **1,57** |
| | **Thailand** | | | |
| 245.000 | KASIKORNBANK PCL | THB | 963.798,73 | 0,48 |
| | | | **963.798,73** | **0,48** |
| | | | **189.025.260,08** | **94,74** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **189.025.260,08** | **94,74** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 4.574.831,65 | HKD | 803.376,72 | AUD | 19/10/2021 | 588.037,84 | 7.346,04 |
| 1.538.024,75 | AUD | 1.308.705.264,00 | KRW | 20/10/2021 | 1.124.065,34 | 5.589,35 |
| 261.962,91 | USD | 357.570,37 | AUD | 19/10/2021 | 261.962,91 | 3.655,45 |
| 978.088,95 | CNY | 205.535,61 | AUD | 19/10/2021 | 151.481,92 | 2.867,34 |
| 3.533.519,00 | TWD | 172.875,53 | AUD | 20/10/2021 | 127.487,92 | 2.153,48 |
| 49.177,83 | AUD | 1.170.156,70 | THB | 19/10/2021 | 35.941,26 | 945,87 |
| 2.338.484,58 | INR | 43.240,49 | AUD | 21/10/2021 | 31.996,23 | 222,53 |
| 135.108.127,00 | IDR | 12.826,89 | AUD | 22/10/2021 | 9.459,70 | 156,22 |
| 22.149,77 | AUD | 13.721,31 | EUR | 19/10/2021 | 16.037,91 | 93,90 |
| 44.939,71 | CNY | 9.576,90 | AUD | 22/10/2021 | 6.954,73 | 33,53 |
| 345,72 | AUD | 341,91 | SGD | 19/10/2021 | 252,67 | (2,09) |
| 68.390,31 | THB | 2.872,30 | AUD | 19/10/2021 | 2.113,58 | (53,90) |
| 13.117,25 | EUR | 21.165,80 | AUD | 19/10/2021 | 15.403,44 | (83,35) |
| 9.490,61 | AUD | 44.939,71 | CNY | 22/10/2021 | 6.905,84 | (95,87) |
| 100.156.217,00 | KRW | 117.458,30 | AUD | 20/10/2021 | 86.554,22 | (248,66) |
| 155.590,49 | AUD | 1.638.245.295,00 | IDR | 22/10/2021 | 113.713,30 | (1.851,67) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asia Income

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 616.215,55 | AUD | 33.234.609,66 | INR | 21/10/2021 | 450.144,20 | (1.948,71) |
| 1.108.332,99 | AUD | 5.277.261,78 | CNY | 19/10/2021 | 810.427,73 | (15.926,40) |
| 1.607.448,24 | AUD | 1.180.761,98 | USD | 19/10/2021 | 1.180.761,98 | (19.547,55) |
| 2.177.584,05 | AUD | 44.312.812,00 | TWD | 20/10/2021 | 1.591.487,24 | (20.068,65) |
| 3.802.275,16 | AUD | 21.736.949,29 | HKD | 19/10/2021 | 2.778.892,68 | (45.671,86) |
| | | | | | **9.390.082,64** | **(82.435,00)** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Marktwert in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Optionen** | | | | |
| (22.233) | CALL TAIWAN STOCK WEIGHTED INDEX 29/09/2021 17418.10 | TWD | 13.514.141,58 | 0,00 |
| (47.776.222) | CALL KOREA STOCK KOSPI 200 INDEX 29/09/2021 414.05 | KRW | 16.193.072,54 | 0,00 |
| (21.832) | CALL TAIWAN STOCK WEIGHTED INDEX 14/10/2021 17340.7694 | TWD | 13.270.397,11 | (56.035,18) |
| (46.840.783) | CALL KOREA STOCK KOSPI 200 INDEX 14/10/2021 409.20 | KRW | 15.876.018,77 | (68.463,18) |
| | | | **58.853.630,00** | **(124.498,36)** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Futures auf Aktienindizes** | | | | |
| 155 | FTSE TAIWAN INDEX 28/10/2021 | USD | 9.169.800,00 | (126.910,00) |
| 111 | KOSPI2 INDEX FUTURE 09/12/2021 | KRW | 9.410.156,25 | (167.250,84) |
| 250 | SGX NIFTY 50 28/10/2021 | USD | 8.801.000,00 | (70.432,00) |
| | | | **27.380.956,25** | **(364.592,84)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(571.526,20)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **189.025.260,08** | **94,74** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(571.526,20)** | **(0,29)** |
| **Bankguthaben** | **5.105.591,74** | **2,56** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **5.964.115,18** | **2,99** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **199.523.440,80** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 471.403.739,40 |
| | 30.09.2020 | USD | 612.517.638,27 |
| | 30.09.2019 | USD | 545.273.828,45 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 9.637,09 |
| | 30.09.2020 | USD | 9.803,11 |
| | 30.09.2019 | USD | 9.557,70 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.043,96 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.204,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.188,16 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.177,49 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.224,27 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.177,76 |
| Capitalisation P Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | SGD | 15,58 |
| | 30.09.2020 | SGD | 15,90 |
| | 30.09.2019 | SGD | 15,65 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.209,33 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.247,86 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.192,06 |
| Capitalisation R Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 254,56 |
| | 30.09.2020 | CHF | 261,91 |
| | 30.09.2019 | CHF | 262,11 |
| Capitalisation U (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.457,42 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.533,18 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.376,92 |
| Capitalisation U Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.941,47 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation U Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | SGD | 7.499,81 |
| | 30.09.2020 | SGD | 7.602,40 |
| | 30.09.2019 | SGD | - |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.970,43 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.022,80 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.990,29 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 315,17 |
| | 30.09.2020 | USD | 326,80 |
| | 30.09.2019 | USD | 324,80 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.541,02 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.596,05 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution I (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.213,81 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.467,95 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.530,47 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 4.777,63 |
| | 30.09.2020 | CHF | - |
| | 30.09.2019 | CHF | - |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 233,92 |
| | 30.09.2020 | EUR | 248,35 |
| | 30.09.2019 | EUR | 256,04 |
| Distribution O (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.233,88 |
| | 30.09.2020 | USD | 4.453,23 |
| | 30.09.2019 | USD | 4.488,36 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.216,20 |
| | 30.09.2020 | USD | 4.434,33 |
| | 30.09.2019 | USD | 4.468,69 |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 233,27 |
| | 30.09.2020 | EUR | 247,65 |
| | 30.09.2019 | EUR | 255,30 |
| Distribution P (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 237,25 |
| | 30.09.2020 | USD | 249,04 |
| | 30.09.2019 | USD | 250,67 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 328,14 |
| | 30.09.2020 | AUD | 343,82 |
| | 30.09.2019 | AUD | - |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.224,37 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution U (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.965,83 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.207,98 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.267,30 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 79,85 |
| | 30.09.2020 | USD | 88,38 |
| | 30.09.2019 | USD | 93,46 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 191,75 |
| | 30.09.2020 | AUD | 213,37 |
| | 30.09.2019 | AUD | 229,17 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 2.600,62 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 2.872,44 |
| | 30.09.2019 | ZAR | 3.045,02 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 181,24 |
| | 30.09.2020 | USD | 202,96 |
| | 30.09.2019 | USD | 216,94 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 216,44 |
| | 30.09.2020 | AUD | 243,59 |
| | 30.09.2019 | AUD | 263,96 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 2.354,08 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 2.654,90 |
| | 30.09.2019 | ZAR | 2.865,58 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 7.716 |
| | 30.09.2020 | 9.036 |
| | 30.09.2019 | 6.695 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 9.310 |
| | 30.09.2020 | 9.276 |
| | 30.09.2019 | 8.879 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 15.052 |
| | 30.09.2020 | 21.285 |
| | 30.09.2019 | 11.644 |
| Capitalisation P Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | 113.340 |
| | 30.09.2020 | 86.919 |
| | 30.09.2019 | 45.150 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 785 |
| | 30.09.2020 | 611 |
| | 30.09.2019 | 448 |
| Capitalisation R Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 3.128 |
| | 30.09.2020 | 6.827 |
| | 30.09.2019 | 4.422 |
| Capitalisation U (USD) | 30.09.2021 | 8.090 |
| | 30.09.2020 | 6.395 |
| | 30.09.2019 | 4.500 |
| Capitalisation U Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 7 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation U Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | 744 |
| | 30.09.2020 | 797 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 18.264 |
| | 30.09.2020 | 25.082 |
| | 30.09.2019 | 26.375 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 16.102 |
| | 30.09.2020 | 24.859 |
| | 30.09.2019 | 15.278 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | 1.472 |
| | 30.09.2020 | 1.472 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution I (Q) (USD) | 30.09.2021 | 5.489 |
| | 30.09.2020 | 10.181 |
| | 30.09.2019 | 10.398 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution I (Q) Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 40 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 30.510 |
| | 30.09.2020 | 42.179 |
| | 30.09.2019 | 40.343 |
| Distribution O (USD) | 30.09.2021 | 688 |
| | 30.09.2020 | 734 |
| | 30.09.2019 | 744 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 4.471 |
| | 30.09.2020 | 6.719 |
| | 30.09.2019 | 6.456 |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 2.110 |
| | 30.09.2020 | 1.598 |
| | 30.09.2019 | 38.665 |
| Distribution P (M) (USD) | 30.09.2021 | 7.036 |
| | 30.09.2020 | 8.828 |
| | 30.09.2019 | 800 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 442 |
| | 30.09.2020 | 819 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 17 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution U (Q) (USD) | 30.09.2021 | 2.226 |
| | 30.09.2020 | 1.558 |
| | 30.09.2019 | 1.739 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 746.399 |
| | 30.09.2020 | 960.456 |
| | 30.09.2019 | 1.113.228 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 105.672 |
| | 30.09.2020 | 139.082 |
| | 30.09.2019 | 164.549 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 29.234 |
| | 30.09.2020 | 41.696 |
| | 30.09.2019 | 38.082 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 171.376 |
| | 30.09.2020 | 248.731 |
| | 30.09.2019 | 165.126 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 40.280 |
| | 30.09.2020 | 53.927 |
| | 30.09.2019 | 35.055 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 55.617 |
| | 30.09.2020 | 79.000 |
| | 30.09.2019 | 60.629 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 38,05 |
| Distribution I (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 40,60 |
| Distribution I (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 43,45 |
| Distribution I (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 44,40 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (CHF) | 11.08.2021 | CHF | 34,70 |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 8,45 |
| Distribution O (USD) | 14.12.2020 | USD | 161,80 |
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 130,05 |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 7,25 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution P (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,56 |
| Distribution P (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,56 |
| Distribution P (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 0,56 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,59 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,59 |
| Distribution P (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,59 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,57 |
| Distribution P (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,57 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,57 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,56 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,56 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 0,56 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,57 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,57 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,57 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,78 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,78 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 0,78 |
| Distribution U (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 40,50 |
| Distribution U (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 42,95 |
| Distribution U (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 45,75 |
| Distribution U (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 46,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,54 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 1,33 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 1,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 27,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,26 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 1,54 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 27,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 27,50 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 27,50 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,30% |
| Capitalisation P Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation R Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 0,92% |
| Capitalisation U (USD) | 30.09.2021 | 0,55% |
| Capitalisation U Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | 0,57% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 2,80% |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | 0,16% |
| Distribution I (Q) (USD) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,82% |
| Distribution O (USD) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,30% |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Distribution P (M) (USD) | 30.09.2021 | 1,30% |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1,31% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Distribution U (Q) (USD) | 30.09.2021 | 0,55% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,80% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 2,82% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 2,82% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 17,82% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **453.068.460,18** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 453.068.460,18 |
| **Bankguthaben** | | **15.656.475,35** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **2.069.252,78** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **33.251.907,76** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***504.046.096,07*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(28.872.477,04)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(3.769.879,63)** |
| Devisentermingeschäfte | | (2.835.082,92) |
| Futures | | (934.796,71) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(32.642.356,67)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***471.403.739,40*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **28.512.125,01** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 28.255.302,68 |
| Bankzinsen | | 12.409,97 |
| Zinsen auf Swaps | | 137.388,88 |
| Sonstige Erträge | 10 | 107.023,48 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(8.045.167,46)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (5.846.773,13) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.908.362,76) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (29.203,51) |
| Abonnementsteuer | 9 | (173.682,89) |
| Bankzinsen | | (3.145,17) |
| Zinsen auf Swaps | | (84.000,00) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **20.466.957,55** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 13.121.605,98 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (11.857.266,93) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 5.738.420,23 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (4.935.590,06) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 370.294,15 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (334.855,72) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (26.391.512,27) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.631.538,66) |
| **Ergebnis** | | **(5.453.485,73)** |
| Zeichnungen | | 188.488.712,11 |
| Rücknahmen | | (306.907.446,53) |
| Ausschüttung | | (17.241.678,72) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 612.517.638,27 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***471.403.739,40*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 750.000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS FRN PERP | USD | 757.758,56 | 0,16 |
| 1.000.000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 1.020.591,93 | 0,22 |
| 2.100.000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 2.105.248,59 | 0,45 |
| 1.100.000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD 3.375% 16/07/2024 | USD | 1.151.363,33 | 0,24 |
| 2.200.000 | CAS CAPITAL NO 1 LTD FRN PERP | USD | 2.223.843,71 | 0,47 |
| 1.000.000 | CCCI TREASURE LTD FRN PERP | USD | 1.023.091,53 | 0,22 |
| 1.350.000 | CHINA TAIPING NEW HORIZON LTD 6.000% 18/10/2023 | USD | 1.463.703,43 | 0,31 |
| 1.600.000 | CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD 4.250% 21/04/2022 | USD | 1.624.842,26 | 0,34 |
| 2.500.000 | CLP POWER HK FINANCE LTD FRN PERP | USD | 2.605.973,33 | 0,55 |
| 1.465.000 | CNPC HK OVERSEAS CAPITAL LTD 5.950% 28/04/2041 | USD | 2.031.591,53 | 0,43 |
| 2.550.000 | CNRC CAPITALE LTD FRN PERP | USD | 2.581.953,90 | 0,55 |
| 4.750.000 | DIANJIAN HAIYU LTD FRN PERP EMTN | USD | 4.797.127,60 | 1,02 |
| 1.150.000 | DIANJIAN HAIYU LTD 29/03/2169 FRN PERP | USD | 1.173.288,93 | 0,25 |
| 420.000 | DIANJIAN INTERNATIONAL FINANCE LTD FRN PERP | USD | 434.697,45 | 0,09 |
| 800.000 | EASY TACTIC LTD 8.125% 11/07/2024 | USD | 527.335,72 | 0,11 |
| 750.000 | EASY TACTIC LTD 8.125% 27/02/2023 | USD | 545.194,31 | 0,12 |
| 3.350.000 | EASY TACTIC LTD 8.625% 27/02/2024 | USD | 2.210.509,86 | 0,47 |
| 2.250.000 | ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD FRN PERP | USD | 2.289.573,34 | 0,49 |
| 3.150.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 3.950% 02/10/2026 | EUR | 3.512.671,54 | 0,75 |
| 2.200.000 | GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD 6.750% 26/09/2023 EMTN | USD | 1.399.877,40 | 0,30 |
| 2.150.000 | HKT CAPITAL NO 5 LTD 3.250% 30/09/2029 | USD | 2.274.927,08 | 0,48 |
| 2.150.000 | HONG SENG LTD 9.875% 27/08/2022 | USD | 2.052.585,71 | 0,44 |
| 10.700.000 | HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD FRN PERP | USD | 10.880.132,15 | 2,30 |
| 1.000.000 | HUARONG FINANCE II CO LTD 5.500% 16/01/2025 EMTN | USD | 988.140,25 | 0,21 |
| 2.000.000 | HUARONG FINANCE 2017 CO LTD FRN PERP EMTN | USD | 1.845.646,72 | 0,39 |
| 2.200.000 | HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.500% 29/05/2029 EMTN | USD | 2.016.081,83 | 0,43 |
| 3.650.000 | HUARONG UNIVERSE INVESTMENT HOLDING LTD 1.625% 05/12/2022 | EUR | 3.462.648,01 | 0,73 |
| 750.000 | MINMETALS BOUNTEOUS FINANCE BVI LTD FRN PERP | USD | 775.339,15 | 0,16 |
| 4.900.000 | NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025 | USD | 4.521.948,29 | 0,96 |
| 2.400.000 | NWD FINANCE (BVI) LTD FRN PERP | USD | 2.374.150,97 | 0,50 |
| 1.800.000 | OCEAN LAUREL CO LTD 2.375% 20/10/2025 | USD | 1.777.232,56 | 0,38 |
| 1.100.000 | POLY REAL ESTATE FINANCE LTD 3.950% 05/02/2023 | USD | 1.129.189,69 | 0,24 |
| 1.000.000 | POLY REAL ESTATE FINANCE LTD 4.750% 17/09/2023 | USD | 1.053.915,08 | 0,22 |
| 2.200.000 | POWERCHINA ROADBRIDGE GROUP BRITISH VIRGIN ISLANDS LTD FRN PERP | USD | 2.213.301,49 | 0,47 |
| 2.500.000 | RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.200% 12/01/2026 | USD | 2.311.657,60 | 0,49 |
| 1.000.000 | SCENERY JOURNEY LTD 11.500% 24/10/2022 | USD | 176.936,45 | 0,04 |
| 2.500.000 | SCENERY JOURNEY LTD 12.000% 24/10/2023 | USD | 440.809,33 | 0,09 |
| 2.200.000 | SCENERY JOURNEY LTD 13.750% 06/11/2023 | USD | 389.638,70 | 0,08 |
| 2.450.000 | SPIC 2018 USD SENIOR PERPETUAL BOND CO LTD FRN PERP | USD | 2.512.685,28 | 0,53 |
| 1.100.000 | STUDIO CITY FINANCE LTD 5.000% 15/01/2029 | USD | 1.015.054,12 | 0,22 |
| 530.000 | TOWNGAS FINANCE LTD FRN PERP | USD | 562.483,31 | 0,12 |
| 600.000 | TSINGHUA UNIC LTD 4.750% 31/01/2021 | USD | 259.046,07 | 0,05 |
| 2.900.000 | TSINGHUA UNIC LTD 5.375% 31/01/2023 | USD | 1.255.016,12 | 0,27 |
| 1.250.000 | YUNDA HOLDING INVESTMENT LTD 2.250% 19/08/2025 | USD | 1.219.071,55 | 0,26 |
| 4.900.000 | 1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.400% 09/03/2023 | USD | 4.935.353,30 | 1,05 |
| | | | **87.923.229,06** | **18,65** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 1.700.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 1.545.108,24 | 0,33 |
| 2.800.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 2.617.559,14 | 0,56 |
| 4.650.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 4.228.300,34 | 0,90 |
| 1.950.000 | CCBL CAYMAN 1 CORP LTD 1.990% 21/07/2025 EMTN | USD | 1.962.225,15 | 0,42 |
| 1.400.000 | CDBL FUNDING TWO 2.000% 04/03/2026 EMTN | USD | 1.404.909,53 | 0,30 |
| 1.700.000 | CDBL FUNDING 1 3.500% 24/10/2027 EMTN | USD | 1.795.898,39 | 0,38 |
| 2.000.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.250% 13/08/2024 | USD | 1.220.000,00 | 0,26 |
| 700.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.650% 27/08/2023 | USD | 450.643,26 | 0,10 |
| 6.300.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.750% 24/05/2024 | USD | 3.870.456,35 | 0,82 |
| 1.250.000 | CHAMPION MTN LTD 2.950% 15/06/2030 EMTN | USD | 1.282.211,18 | 0,27 |
| 1.000.000 | CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.880% 01/03/2027 | USD | 766.812,52 | 0,16 |
| 1.700.000 | CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.200% 24/03/2026 | USD | 1.306.974,65 | 0,28 |
| 1.550.000 | CHINA EVERGRANDE GROUP 8.750% 28/06/2025 | USD | 372.376,70 | 0,08 |
| 2.500.000 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% 22/07/2022 | USD | 2.537.931,45 | 0,54 |
| 400.000 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.375% 02/05/2023 | USD | 409.840,12 | 0,09 |
| 2.200.000 | CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN III LTD 6.375% 29/10/2043 | USD | 3.020.821,52 | 0,64 |
| 3.050.000 | CHINA RESOURCES LAND LTD FRN PERP EMTN | USD | 3.167.320,39 | 0,67 |
| 3.100.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 6.000% 04/02/2026 | USD | 2.778.950,33 | 0,59 |
| 400.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.000% 02/05/2025 | USD | 377.986,84 | 0,08 |
| 2.550.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.375% 09/04/2024 | USD | 2.465.088,37 | 0,52 |
| 1.800.000 | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD 5.625% 14/01/2030 | USD | 1.846.019,74 | 0,39 |
| 700.000 | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD 7.250% 08/04/2026 | USD | 738.682,46 | 0,16 |
| 300.000 | EHI CAR SERVICE 7.750% 14/11/2024 | USD | 301.146,34 | 0,06 |
| 600.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 11.875% 01/06/2023 | USD | 191.748,20 | 0,04 |
| 1.600.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 9.250% 28/07/2023 | USD | 507.967,52 | 0,11 |
| 1.400.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP 10.875% 02/03/2024 | USD | 437.954,59 | 0,09 |
| 4.900.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP 9.875% 19/10/2023 | USD | 1.561.295,87 | 0,33 |
| 1.000.000 | GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 1.035.527,02 | 0,22 |
| 650.000 | HAIDILAO INTERNATIONAL HOLDING LTD 2.150% 14/01/2026 | USD | 628.615,08 | 0,13 |
| 3.434.000 | HILONG HOLDING LTD 9.750% 18/11/2024 | USD | 2.961.813,53 | 0,63 |
| 600.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 10.875% 23/07/2023 | USD | 494.880,47 | 0,10 |
| 1.600.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.250% 16/04/2025 | USD | 1.241.552,66 | 0,26 |
| 1.400.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.650% 01/06/2026 | USD | 1.067.929,80 | 0,23 |
| 1.000.000 | KWG GROUP HOLDINGS LTD 6.000% 14/08/2026 | USD | 890.113,08 | 0,19 |
| 1.650.000 | KWG GROUP HOLDINGS LTD 7.875% 01/09/2023 | USD | 1.602.183,28 | 0,34 |
| 2.250.000 | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD 3.850% 13/01/2032 | USD | 2.297.534,36 | 0,49 |
| 200.000 | RED SUN PROPERTIES GROUP LTD 7.300% 13/01/2025 | USD | 165.990,08 | 0,04 |
| 2.500.000 | RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD 7.100% 25/01/2025 | USD | 1.702.911,55 | 0,36 |
| 1.800.000 | SANDS CHINA LTD 5.125% 08/08/2025 | USD | 1.937.884,97 | 0,41 |
| 1.250.000 | SANDS CHINA LTD 5.400% 08/08/2028 | USD | 1.382.060,03 | 0,29 |
| 1.313.000 | SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD 5.600% 15/07/2026 | USD | 1.303.265,67 | 0,28 |
| 600.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 5.950% 26/04/2024 | USD | 483.044,24 | 0,10 |
| 700.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 6.500% 26/01/2026 | USD | 564.577,28 | 0,12 |
| 1.100.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 6.650% 03/08/2024 | USD | 886.246,64 | 0,19 |
| 1.300.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 5.550% 04/06/2024 | USD | 1.205.121,68 | 0,26 |
| 2.200.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.200% 22/03/2026 | USD | 1.991.732,62 | 0,42 |
| 700.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.750% 16/07/2023 | USD | 679.130,32 | 0,14 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.925.000 | WEIBO CORP 1.250% 15/11/2022 | USD | 1.901.798,90 | 0,40 |
| 4.550.000 | WELL HOPE DEVELOPMENT LTD FRN PERP | USD | 4.645.351,76 | 0,99 |
| 3.700.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD FRN PERP | USD | 2.407.882,26 | 0,51 |
| 600.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 7.700% 20/02/2025 | USD | 443.471,97 | 0,09 |
| 1.200.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.300% 27/05/2025 | USD | 881.821,66 | 0,19 |
| 1.300.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.375% 30/10/2024 | USD | 1.002.141,34 | 0,21 |
| 1.000.000 | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 6.630% 07/01/2026 | USD | 849.769,41 | 0,18 |
| 1.950.000 | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.100% 10/09/2024 | USD | 1.714.748,96 | 0,36 |
| | | | **81.535.329,81** | **17,30** |
| | **Hongkong** | | | |
| 1.350.000 | BANK OF EAST ASIA LTD/THE FRN PERP EMTN | USD | 1.410.013,28 | 0,30 |
| 1.450.000 | BANK OF EAST ASIA LTD/THE 29/05/2030 FRN EMTN | USD | 1.521.178,53 | 0,32 |
| 1.600.000 | BEIJING STATE-OWNED ASSETS MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 4.125% 26/05/2025 | USD | 1.699.972,19 | 0,36 |
| 2.000.000 | CHONG HING BANK LTD FRN PERP EMTN | USD | 2.060.204,70 | 0,44 |
| 1.000.000 | CHONG HING BANK LTD 26/07/2027 FRN | USD | 1.005.827,05 | 0,21 |
| 700.000 | CMB INTERNATIONAL LEASING MANAGEMENT LTD 2.000% 04/02/2026 | USD | 697.748,71 | 0,15 |
| 750.000 | CMB INTERNATIONAL LEASING MANAGEMENT LTD 2.750% 12/08/2030 EMTN | USD | 738.139,10 | 0,16 |
| 4.300.000 | CMB WING LUNG BANK LTD 22/11/2027 FRN EMTN | USD | 4.385.620,61 | 0,92 |
| 2.000.000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.875% 19/06/2029 | USD | 2.140.742,30 | 0,45 |
| 1.135.000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 5.125% 14/03/2028 | USD | 1.297.464,83 | 0,28 |
| 2.200.000 | FAR EAST HORIZON LTD FRN PERP EMTN | USD | 2.205.744,82 | 0,47 |
| 900.000 | FAR EAST HORIZON LTD 2.625% 03/03/2024 EMTN | USD | 901.693,00 | 0,19 |
| 3.350.000 | FAR EAST HORIZON LTD 3.375% 18/02/2025 EMTN | USD | 3.380.695,25 | 0,72 |
| 1.900.000 | FAR EAST HORIZON LTD 4.375% 27/02/2023 EMTN | USD | 1.949.453,07 | 0,41 |
| 1.350.000 | HERO ASIA INVESTMENT LTD 1.500% 18/11/2023 | USD | 1.349.251,71 | 0,29 |
| 700.000 | MCC HOLDING HONG KONG CORP LTD FRN PERP | USD | 712.558,58 | 0,15 |
| 500.000 | NANYANG COMMERCIAL BANK LTD FRN PERP | USD | 504.555,54 | 0,11 |
| 2.100.000 | NANYANG COMMERCIAL BANK LTD 20/11/2029 FRN | USD | 2.195.769,51 | 0,47 |
| 3.000.000 | SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 17/01/2029 FRN | USD | 3.188.910,39 | 0,68 |
| 3.500.000 | SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 29/11/2027 FRN | USD | 3.570.657,58 | 0,76 |
| 650.000 | VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 3.975% 09/11/2027 EMTN | USD | 687.455,45 | 0,15 |
| 850.000 | VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 4.200% 07/06/2024 EMTN | USD | 900.579,78 | 0,19 |
| 200.000 | VANKE REAL ESTATE HONG KONG CO LTD 5.350% 11/03/2024 EMTN | USD | 216.590,94 | 0,05 |
| 9.750.000 | WEICHAI INTERNATIONAL HONG KONG ENERGY GROUP CO LTD FRN PERP | USD | 9.928.507,78 | 2,10 |
| 1.100.000 | XIAOMI BEST TIME INTERNATIONAL LTD 4.100% 14/07/2051 | USD | 1.102.571,40 | 0,23 |
| 1.000.000 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD 7.500% 15/04/2024 | USD | 782.318,12 | 0,17 |
| 900.000 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD 7.500% 17/02/2025 | USD | 585.038,71 | 0,12 |
| 450.000 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD 8.250% 25/11/2023 | USD | 303.491,76 | 0,06 |
| | | | **51.422.754,69** | **10,91** |
| | **Thailand** | | | |
| 4.000.000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 4.167.012,44 | 0,88 |
| 1.200.000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 25/09/2034 FRN EMTN | USD | 1.221.864,76 | 0,26 |
| 2.450.000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 9.025% 15/03/2029 | USD | 3.367.720,00 | 0,71 |
| 1.150.000 | GC TREASURY CENTER CO LTD 4.300% 18/03/2051 | USD | 1.260.489,37 | 0,27 |
| 1.250.000 | INDORAMA VENTURES GLOBAL SERVICES LTD 4.375% 12/09/2024 | USD | 1.270.681,41 | 0,27 |
| 2.000.000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 2.095.930,12 | 0,44 |
| 3.300.000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG 02/10/2031 FRN EMTN | USD | 3.331.748,57 | 0,71 |
| 4.000.000 | KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS FRN PERP | USD | 3.997.485,32 | 0,85 |
| 850.000 | MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP | USD | 865.634,52 | 0,18 |
| 5.700.000 | MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP | USD | 5.702.482,69 | 1,21 |
| 1.640.000 | THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD 5.375% 20/11/2048 | USD | 1.851.022,34 | 0,39 |
| 8.550.000 | TMBTHANACHART BANK PCL FRN PERP EMTN | USD | 8.643.219,45 | 1,84 |
| | | | **37.775.290,99** | **8,01** |
| | **China** | | | |
| 40.000.000 | CENTRAL HUIJIN INVESTMENT LTD 2.710% 22/05/2025 | CNH | 6.101.551,16 | 1,30 |
| 3.300.000 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 24/06/2030 FRN | USD | 3.350.377,17 | 0,71 |
| 4.700.000 | CHINA DEVELOPMENT BANK FINANCIAL LEASING CO LTD 28/09/2030 FRN | USD | 4.768.810,21 | 1,01 |
| 40.000.000 | CHINA DEVELOPMENT BANK 3.180% 05/04/2026 | CNY | 6.215.881,96 | 1,32 |
| 5.310.000 | CHINA MINMETALS CORP FRN PERP | USD | 5.420.332,72 | 1,15 |
| 2.640.000 | SHOUGANG GROUP CO LTD 4.000% 23/05/2024 | USD | 2.782.275,94 | 0,59 |
| 3.000.000 | WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD 3.258% 29/10/2030 | USD | 2.455.211,19 | 0,52 |
| | | | **31.094.440,35** | **6,60** |
| | **Indonesien** | | | |
| 1.762.000 | ALAM SUTERA REALTY TBK 6.250% 02/11/2025 | USD | 1.400.281,80 | 0,30 |
| 1.550.000 | BANK NEGARA INDONESIA 3.750% 30/03/2026 EMTN | USD | 1.593.525,44 | 0,34 |
| 3.950.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.500% 12/10/2035 | USD | 6.187.311,56 | 1,31 |
| 1.500.000 | JAPFA COMFEED INDONESIA TBK PT 5.375% 23/03/2026 | USD | 1.588.885,89 | 0,34 |
| 800.000 | PERTAMINA PERSERO PT 6.000% 03/05/2042 | USD | 984.722,86 | 0,21 |
| 10.450.000 | PERTAMINA PERSERO PT 6.500% 27/05/2041 | USD | 13.546.351,82 | 2,87 |
| | | | **25.301.079,37** | **5,37** |
| | **Australien** | | | |
| 2.800.000 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UNITED KINGDOM FRN PERP | USD | 3.279.917,82 | 0,70 |
| 550.000 | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 12/09/2034 FRN EMTN | USD | 582.413,85 | 0,12 |
| 1.540.000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 02/08/2034 FRN | USD | 1.655.560,00 | 0,35 |
| 500.000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 02/08/2034 FRN EMTN | USD | 537.519,48 | 0,11 |
| 1.200.000 | QBE INSURANCE GROUP LTD 02/12/2044 FRN | USD | 1.362.514,60 | 0,29 |
| 5.550.000 | QBE INSURANCE GROUP LTD 17/06/2046 FRN EMTN | USD | 6.275.288,15 | 1,34 |
| 3.400.000 | SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031 | USD | 3.456.849,16 | 0,73 |
| 600.000 | SANTOS FINANCE LTD 5.250% 13/03/2029 EMTN | USD | 672.572,35 | 0,14 |
| 2.000.000 | SCENTRE GROUP TRUST 2 24/09/2080 FRN | USD | 2.157.395,30 | 0,46 |
| 3.600.000 | WESTPAC BANKING CORP 24/07/2034 FRN | USD | 3.910.497,23 | 0,83 |
| | | | **23.890.527,94** | **5,07** |
| | **Japan** | | | |
| 2.650.000 | ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 2.701.845,02 | 0,57 |
| 4.700.000 | ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 5.055.170,35 | 1,07 |
| 1.950.000 | FUKOKU MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 2.149.652,66 | 0,46 |
| 2.750.000 | MEIJI YASUDA LIFE INSURANCE CO 20/10/2045 FRN | USD | 3.090.928,47 | 0,66 |
| 5.000.000 | MITSUI SUMITOMO INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 5.692.420,50 | 1,21 |
| 600.000 | NIPPON LIFE INSURANCE CO 20/01/2046 FRN | USD | 664.647,39 | 0,14 |
| 1.750.000 | NIPPON LIFE INSURANCE 21/01/2051 FRN | USD | 1.713.772,11 | 0,36 |
| 1.750.000 | SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 15/04/2081 FRN | USD | 1.818.423,04 | 0,39 |
| | | | **22.886.859,54** | **4,86** |
| | **Südkorea** | | | |
| 5.800.000 | HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 6.045.376,60 | 1,28 |
| 6.000.000 | HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 6.089.966,34 | 1,29 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 5.025.000 | KYOBO LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 5.117.481,61 | 1,09 |
| 3.800.000 | TONGYANG LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 4.016.806,68 | 0,85 |
| | | | **21.269.631,23** | **4,51** |
| | **Singapur** | | | |
| 496.250 | CONTINUUM ENERGY LEVANTER PTE LTD 4.500% 09/02/2027 | USD | 511.963,19 | 0,11 |
| 2.050.000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP GMTN | USD | 2.106.324,04 | 0,45 |
| 1.400.000 | GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025 | USD | 1.444.539,14 | 0,31 |
| 1.300.000 | JGC VENTURES PTE LTD 10.750% 30/08/2021 | USD | 718.031,59 | 0,15 |
| 1.703.730 | LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 04/02/2039 | USD | 1.998.422,76 | 0,42 |
| 1.150.000 | LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.500% 09/02/2026 | USD | 1.190.402,46 | 0,25 |
| 1.850.000 | MODERNLAND OVERSEAS PTE LTD 6.950% 13/04/2024 | USD | 853.550,78 | 0,18 |
| 1.500.000 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 10/09/2030 FRN | USD | 1.495.516,80 | 0,32 |
| | | | **10.318.750,76** | **2,19** |
| | **Indien** | | | |
| 1.075.250 | ADANI TRANSMISSION LTD 4.250% 21/05/2036 | USD | 1.099.713,64 | 0,23 |
| 1.000.000 | HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.450% 22/10/2026 | USD | 1.040.065,15 | 0,22 |
| 800.000 | IIFL FINANCE LTD 5.875% 20/04/2023 EMTN | USD | 778.142,60 | 0,17 |
| 2.450.000 | JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 18/05/2031 | USD | 2.439.857,10 | 0,51 |
| 2.200.000 | POWER FINANCE CORP LTD 3.750% 06/12/2027 EMTN | USD | 2.307.528,52 | 0,49 |
| 1.400.000 | RELIANCE INDUSTRIES LTD 8.250% 15/01/2027 | USD | 1.829.430,48 | 0,39 |
| | | | **9.494.737,49** | **2,01** |
| | **Niederlande** | | | |
| 1.625.250 | GREENKO DUTCH BV 3.850% 29/03/2026 | USD | 1.652.334,09 | 0,35 |
| 7.350.000 | MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 10/08/2037 | USD | 7.810.863,67 | 1,65 |
| | | | **9.463.197,76** | **2,00** |
| | **Bermuda** | | | |
| 1.650.000 | CHINA OIL & GAS GROUP LTD 4.700% 30/06/2026 | USD | 1.683.307,74 | 0,36 |
| 2.050.000 | CHINA OIL & GAS GROUP LTD 5.500% 25/01/2023 | USD | 2.092.954,00 | 0,44 |
| 5.310.000 | SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 5.445.051,73 | 1,16 |
| | | | **9.221.313,47** | **1,96** |
| | **Philippinen** | | | |
| 400.000 | GLOBE TELECOM INC 2.500% 23/07/2030 | USD | 385.112,17 | 0,08 |
| 3.950.000 | GLOBE TELECOM INC 3.000% 23/07/2035 | USD | 3.666.642,92 | 0,78 |
| 4.450.000 | SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP | USD | 4.656.006,25 | 0,99 |
| | | | **8.707.761,34** | **1,85** |
| | **Kanada** | | | |
| 1.000.000 | CNOOC PETROLEUM NORTH AMERICA ULC 5.875% 10/03/2035 | USD | 1.246.099,38 | 0,26 |
| 3.100.000 | CNOOC PETROLEUM NORTH AMERICA ULC 6.400% 15/05/2037 | USD | 4.127.785,44 | 0,88 |
| 1.100.000 | PTTEP CANADA INTERNATIONAL FINANCE LTD 6.350% 12/06/2042 | USD | 1.522.347,35 | 0,32 |
| | | | **6.896.232,17** | **1,46** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 1.000.000 | PERIAMA HOLDINGS LLC/DE 5.950% 19/04/2026 | USD | 1.072.643,48 | 0,23 |
| 1.900.000 | RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 06/04/2031 | USD | 1.908.079,77 | 0,41 |
| 1.500.000 | RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 16/04/2029 | USD | 1.525.762,86 | 0,32 |
| | | | **4.506.486,11** | **0,96** |
| | **Insel Man** | | | |
| 3.850.000 | GOHL CAPITAL LTD 4.250% 24/01/2027 | USD | 4.051.995,29 | 0,86 |
| | | | **4.051.995,29** | **0,86** |
| | **Mauritius** | | | |
| 400.000 | CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS PTE LTD 4.250% 25/03/2027 | USD | 404.751,36 | 0,09 |
| 2.200.000 | UPL CORP LTD FRN PERP | USD | 2.243.806,51 | 0,47 |
| 1.150.000 | UPL CORP LTD 4.625% 16/06/2030 | USD | 1.221.434,45 | 0,25 |
| | | | **3.869.992,32** | **0,81** |
| | **Sri Lanka** | | | |
| 1.000.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.825% 18/07/2026 | USD | 621.104,21 | 0,13 |
| 1.700.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.550% 28/03/2030 | USD | 1.038.077,19 | 0,22 |
| 750.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.850% 14/03/2029 | USD | 457.853,75 | 0,10 |
| 2.150.000 | SRILANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024 | USD | 1.321.775,34 | 0,28 |
| | | | **3.438.810,49** | **0,73** |
| | | | **453.068.420,18** | **96,11** |

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Anleihen und andere Schuldtitel

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | **Bermuda** | | | |
| 400.000 | 3D-GOLD JEWELLERY HOLDINGS LTD 9.250% 17/10/2014 - DEFAULTED | USD | 40,00 | 0,00 |
| | | | **40,00** | **0,00** |
| | | | **40,00** | **0,00** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **453.068.460,18** | **96,11** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 7.627.316,28 | USD | 6.460.000,00 | EUR | 29/10/2021 | 7.627.316,28 | 136.853,28 |
| 1.869.271,81 | USD | 27.175.204,58 | ZAR | 19/10/2021 | 1.869.271,81 | 66.852,34 |
| 5.268.867,42 | USD | 4.489.757,11 | EUR | 19/10/2021 | 5.268.867,42 | 63.925,23 |
| 1.595.134,04 | USD | 2.172.708,22 | AUD | 19/10/2021 | 1.595.134,04 | 25.577,97 |
| 1.115.986,81 | USD | 1.033.356,39 | CHF | 19/10/2021 | 1.115.986,81 | 7.817,94 |
| 137.986,99 | USD | 186.535,11 | SGD | 19/10/2021 | 137.986,99 | 590,60 |
| 531.643,88 | ZAR | 35.028,42 | USD | 04/10/2021 | 35.028,42 | 308,49 |
| 929.308,46 | ZAR | 61.553,80 | USD | 01/10/2021 | 61.553,80 | 214,79 |
| 90.740,29 | USD | 125.392,51 | AUD | 01/10/2021 | 90.740,29 | 163,05 |
| 40.955,77 | AUD | 29.441,05 | USD | 05/10/2021 | 29.441,05 | 143,47 |
| 220,98 | USD | 299,99 | SGD | 01/10/2021 | 220,98 | 0,01 |
| 2.617,33 | USD | 39.515,18 | ZAR | 01/10/2021 | 2.617,33 | (9,14) |
| 399.998,36 | EUR | 466.938,09 | USD | 01/10/2021 | 466.938,09 | (3.359,99) |
| 300.000,00 | EUR | 352.707,37 | USD | 29/10/2021 | 352.707,37 | (4.853,05) |
| 2.023.699,61 | CHF | 2.215.851,62 | USD | 19/10/2021 | 2.215.851,62 | (45.641,10) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asian Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 7.653.962,24 | SGD | 5.694.402,40 | USD | 19/10/2021 | 5.694.402,40 | (56.714,23) |
| 31.833.223,29 | AUD | 23.471.655,62 | USD | 19/10/2021 | 23.471.655,62 | (475.457,38) |
| 236.938.404,70 | ZAR | 16.387.031,48 | USD | 19/10/2021 | 16.387.031,48 | (671.882,27) |
| 69.031.594,30 | EUR | 81.907.429,34 | USD | 19/10/2021 | 81.907.429,34 | (1.879.612,93) |
| | | | | | **148.330.181,14** | **(2.835.082,92)** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| 24 | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 3.821.250,00 | (113.610,58) |
| 105 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 20.061.562,50 | (826.704,38) |
| 86 | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 11.318.406,25 | (170.466,10) |
| (30) | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 4.357.500,00 | 97.031,25 |
| 42 | US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 9.242.296,90 | (4.499,98) |
| (98) | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 12.028.734,42 | 83.453,08 |
| | | | **60.829.750,07** | **(934.796,71)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(3.769.879,63)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **453.068.460,18** | **96,11** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(3.769.879,63)** | **(0,80)** |
| **Bankguthaben** | **15.656.475,35** | **3,32** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **6.448.683,50** | **1,37** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **471.403.739,40** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asian High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 249.371.883,08 |
| | 30.09.2020 | USD | 235.556.943,34 |
| | 30.09.2019 | USD | 188.757.483,65 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.611,71 |
| | 30.09.2020 | USD | 6.759,30 |
| | 30.09.2019 | USD | 6.726,68 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.281,96 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.452,60 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.552,27 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 268,50 |
| | 30.09.2020 | USD | 275,65 |
| | 30.09.2019 | USD | 275,48 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 283,51 |
| | 30.09.2020 | EUR | 293,79 |
| | 30.09.2019 | EUR | 300,08 |
| Capitalisation U (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.886,10 |
| | 30.09.2020 | USD | 4.978,54 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution I (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.304,09 |
| | 30.09.2020 | USD | 4.725,70 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.046,13 |
| Distribution P (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 209,26 |
| | 30.09.2020 | USD | 229,75 |
| | 30.09.2019 | USD | 245,78 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 290,19 |
| | 30.09.2020 | AUD | 319,79 |
| | 30.09.2019 | AUD | 346,74 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 208,83 |
| | 30.09.2020 | EUR | 232,09 |
| | 30.09.2019 | EUR | 251,77 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | SGD | 291,60 |
| | 30.09.2020 | SGD | 320,04 |
| | 30.09.2019 | SGD | 343,90 |
| Distribution U (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.320,64 |
| | 30.09.2020 | USD | 4.743,96 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.066,42 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 21.431 |
| | 30.09.2020 | | 15.300 |
| | 30.09.2019 | | 17.386 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 4.476 |
| | 30.09.2020 | | 4.592 |
| | 30.09.2019 | | 3.237 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 95.252 |
| | 30.09.2020 | | 47.724 |
| | 30.09.2019 | | 25.135 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 905 |
| | 30.09.2020 | | 1.923 |
| | 30.09.2019 | | 3.318 |
| Capitalisation U (USD) | 30.09.2021 | | 41 |
| | 30.09.2020 | | 868 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Distribution I (M) (USD) | 30.09.2021 | | 1.755 |
| | 30.09.2020 | | 1.874 |
| | 30.09.2019 | | 1.529 |
| Distribution P (M) (USD) | 30.09.2021 | | 96.148 |
| | 30.09.2020 | | 152.686 |
| | 30.09.2019 | | 72.400 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | | 27.135 |
| | 30.09.2020 | | 47.073 |
| | 30.09.2019 | | 27.900 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 17.764 |
| | 30.09.2020 | | 22.317 |
| | 30.09.2019 | | 2.166 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | | 62.704 |
| | 30.09.2020 | | 77.206 |
| | 30.09.2019 | | 40.742 |
| Distribution U (M) (USD) | 30.09.2021 | | 712 |
| | 30.09.2020 | | 1.210 |
| | 30.09.2019 | | 285 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Dividende** | | | |
| Distribution I (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 29,45 |
| Distribution I (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 29,45 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 29,45 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 28,40 |
| Distribution I (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 28,40 |
| Distribution I (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 28,40 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asian High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 27,53 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 27,53 |
| Distribution I (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 27,53 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 26,96 |
| Distribution I (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 26,96 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 26,96 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,35 |
| Distribution P (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,35 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,35 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,30 |
| Distribution P (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,30 |
| Distribution P (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,30 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution P (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,26 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,23 |
| Distribution P (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,23 |
| Distribution P (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,23 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 1,87 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 1,87 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 1,87 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 1,81 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 1,81 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 1,81 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 1,75 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 1,75 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 1,75 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 1,72 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 1,72 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 1,72 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 02.09.2021 | EUR | 1,36 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 03.08.2021 | EUR | 1,36 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 02.07.2021 | EUR | 1,36 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 02.06.2021 | EUR | 1,31 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 04.05.2021 | EUR | 1,31 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 07.04.2021 | EUR | 1,31 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 02.03.2021 | EUR | 1,28 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 02.02.2021 | EUR | 1,28 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 05.01.2021 | EUR | 1,28 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 02.12.2020 | EUR | 1,41 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 03.11.2020 | EUR | 1,41 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 02.10.2020 | EUR | 1,41 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 02.09.2021 | SGD | 1,88 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 03.08.2021 | SGD | 1,88 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 02.07.2021 | SGD | 1,88 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 02.06.2021 | SGD | 1,81 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 04.05.2021 | SGD | 1,81 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 07.04.2021 | SGD | 1,81 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 02.03.2021 | SGD | 1,75 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 02.02.2021 | SGD | 1,75 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 05.01.2021 | SGD | 1,75 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 02.12.2020 | SGD | 1,71 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 03.11.2020 | SGD | 1,71 |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 02.10.2020 | SGD | 1,71 |
| Distribution U (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 30,86 |
| Distribution U (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 30,86 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asian High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution U (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 30,86 |
| Distribution U (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 29,81 |
| Distribution U (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 29,81 |
| Distribution U (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 29,81 |
| Distribution U (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 28,96 |
| Distribution U (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 28,96 |
| Distribution U (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 28,96 |
| Distribution U (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 28,40 |
| Distribution U (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 28,40 |
| Distribution U (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 28,40 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,30% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Capitalisation U (USD) | 30.09.2021 | 0,54% |
| Distribution I (M) (USD) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Distribution P (M) (USD) | 30.09.2021 | 1,30% |
| Distribution P (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Distribution P (M) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Distribution P (M) Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Distribution U (M) (USD) | 30.09.2021 | 0,55% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 12,38% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Asian High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **230.235.181,07** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 230.235.181,07 |
| **Bankguthaben** | | **14.479.610,92** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **11.830.845,96** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***256.545.637,95*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(6.180.402,63)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(993.352,24)** |
| Devisentermingeschäfte | | (993.352,24) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(7.173.754,87)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***249.371.883,08*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **16.903.919,48** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 16.728.696,03 |
| Bankzinsen | | 966,84 |
| Zinsen auf Swaps | | 84.677,79 |
| Sonstige Erträge | 10 | 89.578,82 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(2.615.178,48)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.076.527,14) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (468.475,41) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (13.091,33) |
| Abonnementsteuer | 9 | (57.084,60) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **14.288.741,00** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 4.021.561,54 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (5.329.988,15) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 353.256,87 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (519.121,82) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 157.163,90 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (134.086,57) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (20.041.555,24) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 89.650,42 |
| **Ergebnis** | | **(7.114.378,05)** |
| Zeichnungen | | 126.301.834,57 |
| Rücknahmen | | (100.528.491,74) |
| Ausschüttung | | (4.844.025,04) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 235.556.943,34 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***249.371.883,08*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asian High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Kaimaninseln** | | | | |
| 600.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 545.332,32 | 0,22 |
| 750.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 701.131,91 | 0,28 |
| 5.000.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 4.546.559,50 | 1,82 |
| 2.150.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.250% 13/08/2024 | USD | 1.311.500,00 | 0,53 |
| 450.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.650% 27/08/2023 | USD | 289.699,24 | 0,12 |
| 2.450.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.750% 24/05/2024 | USD | 1.505.177,47 | 0,60 |
| 1.300.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.900% 07/11/2023 | USD | 834.086,58 | 0,33 |
| 1.500.000 | CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.880% 01/03/2027 | USD | 1.150.218,78 | 0,46 |
| 1.000.000 | CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.980% 18/08/2025 | USD | 767.143,80 | 0,31 |
| 1.000.000 | CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.200% 24/03/2026 | USD | 768.808,62 | 0,31 |
| 250.000 | CHINA AOYUAN GROUP 7.950% 21/06/2024 | USD | 213.976,50 | 0,09 |
| 1.700.000 | CHINA EVERGRANDE GROUP 10.000% 11/04/2023 | USD | 410.061,11 | 0,16 |
| 750.000 | CHINA EVERGRANDE GROUP 11.500% 22/01/2023 | USD | 181.785,25 | 0,07 |
| 1.800.000 | CHINA EVERGRANDE GROUP 9.500% 29/03/2024 | USD | 433.109,75 | 0,17 |
| 700.000 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% 22/07/2022 | USD | 710.620,81 | 0,28 |
| 2.200.000 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.375% 02/05/2023 | USD | 2.254.120,68 | 0,90 |
| 400.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 5.950% 29/09/2024 | USD | 369.692,07 | 0,15 |
| 1.300.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 6.000% 04/02/2026 | USD | 1.165.366,27 | 0,47 |
| 750.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.000% 02/05/2025 | USD | 708.725,33 | 0,28 |
| 1.400.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.250% 19/04/2023 | USD | 1.365.113,40 | 0,55 |
| 2.700.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.375% 09/04/2024 | USD | 2.610.093,56 | 1,05 |
| 1.500.000 | CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD FRN PERP | USD | 1.487.486,97 | 0,60 |
| 800.000 | CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD 6.000% 16/07/2025 | USD | 801.496,57 | 0,32 |
| 1.400.000 | CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD 6.550% 28/03/2024 | USD | 1.413.256,71 | 0,57 |
| 1.000.000 | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD 5.625% 14/01/2030 | USD | 1.025.566,52 | 0,41 |
| 1.700.000 | EHI CAR SERVICE 7.750% 14/11/2024 | USD | 1.706.495,94 | 0,68 |
| 2.250.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 10.875% 09/01/2023 | USD | 720.752,45 | 0,29 |
| 1.800.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 9.250% 28/07/2023 | USD | 571.463,46 | 0,23 |
| 600.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP 10.875% 02/03/2024 | USD | 187.694,83 | 0,08 |
| 2.400.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP 9.875% 19/10/2023 | USD | 764.716,34 | 0,31 |
| 2.899.000 | HILONG HOLDING LTD 9.750% 18/11/2024 | USD | 2.500.377,82 | 1,00 |
| 650.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 10.875% 23/07/2023 | USD | 536.120,51 | 0,21 |
| 3.750.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.250% 16/04/2025 | USD | 2.909.889,04 | 1,17 |
| 650.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.650% 01/06/2026 | USD | 495.824,55 | 0,20 |
| 1.000.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 8.500% 30/06/2022 | USD | 865.815,35 | 0,35 |
| 1.100.000 | KWG GROUP HOLDINGS LTD 6.000% 14/08/2026 | USD | 979.124,39 | 0,39 |
| 1.000.000 | KWG GROUP HOLDINGS LTD 7.400% 05/03/2024 EMTN | USD | 969.685,38 | 0,39 |
| 1.200.000 | KWG GROUP HOLDINGS LTD 7.875% 01/09/2023 | USD | 1.165.224,20 | 0,47 |
| 1.800.000 | MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.250% 26/04/2026 | USD | 1.811.184,34 | 0,73 |
| 1.000.000 | MELCO RESORTS FINANCE LTD 5.750% 21/07/2028 | USD | 1.022.714,88 | 0,41 |
| 3.050.000 | MGM CHINA HOLDINGS LTD 4.750% 01/02/2027 | USD | 3.008.133,69 | 1,21 |
| 2.000.000 | MGM CHINA HOLDINGS LTD 5.250% 18/06/2025 | USD | 2.019.364,02 | 0,81 |
| 1.000.000 | MGM CHINA HOLDINGS LTD 5.875% 15/05/2026 | USD | 1.020.095,60 | 0,41 |
| 400.000 | RED SUN PROPERTIES GROUP LTD 7.300% 13/01/2025 | USD | 331.980,17 | 0,13 |
| 1.350.000 | RED SUN PROPERTIES GROUP LTD 9.500% 20/09/2023 | USD | 1.224.698,97 | 0,49 |
| 1.300.000 | RED SUN PROPERTIES GROUP 9.700% 16/04/2023 | USD | 1.190.929,58 | 0,48 |
| 2.300.000 | RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD 7.100% 25/01/2025 | USD | 1.566.678,63 | 0,63 |
| 2.100.000 | RONSHINE CHINA HOLDINGS LTD 7.350% 15/12/2023 | USD | 1.577.446,46 | 0,63 |
| 950.000 | SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD 5.200% 16/01/2027 | USD | 920.255,95 | 0,37 |
| 800.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 5.950% 26/04/2024 | USD | 644.058,98 | 0,26 |
| 1.400.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 6.500% 26/01/2026 | USD | 1.129.154,56 | 0,45 |
| 800.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 6.650% 03/08/2024 | USD | 644.543,01 | 0,26 |
| 1.600.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 7.000% 09/07/2025 | USD | 1.289.596,32 | 0,52 |
| 750.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 5.550% 04/06/2024 | USD | 695.262,51 | 0,28 |
| 750.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 5.750% 14/01/2027 | USD | 666.327,14 | 0,27 |
| 1.250.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.200% 22/03/2026 | USD | 1.131.666,26 | 0,45 |
| 1.000.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.750% 08/07/2025 | USD | 920.975,35 | 0,37 |
| 1.600.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.750% 16/07/2023 | USD | 1.552.297,87 | 0,62 |
| 4.150.000 | WYNN MACAU LTD 5.500% 15/01/2026 | USD | 4.025.150,53 | 1,61 |
| 1.800.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD FRN PERP | USD | 1.171.402,18 | 0,47 |
| 1.500.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 7.375% 13/01/2026 | USD | 995.512,64 | 0,40 |
| 3.150.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.300% 27/05/2025 | USD | 2.314.781,85 | 0,93 |
| 400.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.375% 30/10/2024 | USD | 308.351,18 | 0,12 |
| 3.300.000 | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 6.630% 07/01/2026 | USD | 2.804.239,05 | 1,12 |
| 1.300.000 | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.100% 10/09/2024 | USD | 1.143.165,97 | 0,46 |
| | | | **79.073.281,67** | **31,71** |
| **Jungferninseln** | | | | |
| 2.900.000 | CAS CAPITAL NO 1 LTD FRN PERP | USD | 2.931.430,35 | 1,18 |
| 600.000 | EASY TACTIC LTD 5.875% 13/02/2023 | USD | 435.456,76 | 0,17 |
| 900.000 | EASY TACTIC LTD 8.125% 27/02/2023 | USD | 654.233,18 | 0,26 |
| 6.000.000 | EASY TACTIC LTD 8.625% 27/02/2024 | USD | 3.959.122,14 | 1,58 |
| 1.850.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 3.950% 02/10/2026 | EUR | 2.062.997,58 | 0,83 |
| 2.400.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 5.000% 18/05/2026 | USD | 2.371.804,99 | 0,95 |
| 1.850.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 5.950% 19/10/2025 | USD | 1.886.535,69 | 0,76 |
| 1.300.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 6.750% 02/07/2023 | USD | 1.344.388,68 | 0,54 |
| 400.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 6.850% 02/07/2024 | USD | 416.382,47 | 0,17 |
| 1.950.000 | GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD 5.900% 12/02/2023 EMTN | USD | 1.444.167,37 | 0,58 |
| 1.000.000 | GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD 6.125% 22/04/2023 EMTN | USD | 702.090,61 | 0,28 |
| 300.000 | GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD 6.750% 26/09/2023 EMTN | USD | 190.892,37 | 0,08 |
| 2.250.000 | HONG SENG LTD 9.875% 27/08/2022 | USD | 2.148.054,82 | 0,86 |
| 1.000.000 | NEW METRO GLOBAL LTD 4.500% 02/05/2026 | USD | 916.170,47 | 0,37 |
| 2.350.000 | NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025 | USD | 2.168.689,49 | 0,87 |
| 500.000 | NEW METRO GLOBAL LTD 5.000% 08/08/2022 | USD | 489.117,71 | 0,20 |
| 1.150.000 | NWD FINANCE (BVI) LTD FRN PERP | USD | 1.137.614,01 | 0,46 |
| 2.000.000 | RKPF OVERSEAS 2020 A LTD 5.200% 12/01/2026 | USD | 1.849.326,08 | 0,74 |
| 2.500.000 | SCENERY JOURNEY LTD 11.500% 24/10/2022 | USD | 442.341,13 | 0,18 |
| 750.000 | SCENERY JOURNEY LTD 12.000% 24/10/2023 | USD | 132.242,80 | 0,05 |
| 1.500.000 | SCENERY JOURNEY LTD 13.750% 06/11/2023 | USD | 265.662,75 | 0,11 |
| 3.236.455 | STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG WINDU LTD 6.750% 24/04/2033 | USD | 3.716.512,93 | 1,49 |
| 1.500.000 | STUDIO CITY FINANCE LTD 5.000% 15/01/2029 | USD | 1.384.164,71 | 0,56 |
| 3.600.000 | STUDIO CITY FINANCE LTD 6.500% 15/01/2028 | USD | 3.528.222,23 | 1,41 |
| 700.000 | TSINGHUA UNIC LTD 4.750% 31/01/2021 | USD | 302.220,42 | 0,12 |
| 3.600.000 | TSINGHUA UNIC LTD 5.375% 31/01/2023 | USD | 1.557.951,05 | 0,61 |
| 2.000.000 | 1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.400% 09/03/2023 | USD | 2.014.429,92 | 0,81 |
| | | | **40.452.222,71** | **16,22** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asian High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Mauritius** | | | |
| 2.400.000 | CLEAN RENEWABLE POWER MAURITIUS PTE LTD 4.250% 25/03/2027 | USD | 2.428.508,16 | 0,97 |
| 5.750.000 | GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 16/08/2023 | USD | 5.780.308,83 | 2,33 |
| 1.000.000 | GREENKO SOLAR MAURITIUS LTD 5.950% 29/07/2026 | USD | 1.060.452,53 | 0,43 |
| 4.162.000 | NETWORK I2I LTD FRN PERP | USD | 4.434.538,79 | 1,78 |
| 2.750.000 | UPL CORP LTD FRN PERP | USD | 2.804.758,14 | 1,12 |
| | | | **16.508.566,45** | **6,63** |
| | **Indien** | | | |
| 1.050.000 | ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% 08/09/2024 | USD | 1.052.198,28 | 0,42 |
| 1.500.000 | HDFC BANK LTD FRN PERP | USD | 1.496.425,07 | 0,60 |
| 2.600.000 | HPCL-MITTAL ENERGY LTD 5.450% 22/10/2026 | USD | 2.704.169,39 | 1,08 |
| 1.200.000 | IIFL FINANCE LTD 5.875% 20/04/2023 EMTN | USD | 1.167.213,90 | 0,47 |
| 4.050.000 | JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 18/05/2031 | USD | 4.033.233,16 | 1,62 |
| 800.000 | JSW STEEL LTD 5.050% 05/04/2032 | USD | 796.307,18 | 0,32 |
| 1.000.000 | JSW STEEL LTD 5.375% 04/04/2025 | USD | 1.053.848,35 | 0,42 |
| 2.750.000 | JSW STEEL LTD 5.950% 18/04/2024 | USD | 2.911.737,46 | 1,17 |
| 1.000.000 | MUTHOOT FINANCE LTD 4.400% 02/09/2023 EMTN | USD | 1.019.118,23 | 0,41 |
| | | | **16.234.251,02** | **6,51** |
| | **Thailand** | | | |
| 2.300.000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 2.396.032,15 | 0,96 |
| 5.050.000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 5.292.223,55 | 2,12 |
| 2.200.000 | KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS FRN PERP | USD | 2.198.616,93 | 0,88 |
| 4.800.000 | TMBTHANACHART BANK PCL FRN PERP EMTN | USD | 4.852.333,73 | 1,95 |
| | | | **14.739.206,36** | **5,91** |
| | **Singapur** | | | |
| 1.000.000 | ABJA INVESTMENT CO PTE LTD 5.450% 24/01/2028 | USD | 1.089.902,68 | 0,44 |
| 2.000.000 | ABJA INVESTMENT CO PTE LTD 5.950% 31/07/2024 | USD | 2.161.003,38 | 0,87 |
| 397.000 | CONTINUUM ENERGY LEVANTER PTE LTD 4.500% 09/02/2027 | USD | 409.570,55 | 0,16 |
| 1.500.000 | GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025 | USD | 1.547.720,51 | 0,62 |
| 400.000 | JGC VENTURES PTE LTD 10.750% 30/08/2021 | USD | 220.932,80 | 0,09 |
| 717.360 | LLPL CAPITAL PTE LTD 6.875% 04/02/2039 | USD | 841.441,16 | 0,34 |
| 1.580.000 | LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.250% 19/06/2024 | USD | 1.643.547,84 | 0,66 |
| 1.050.000 | LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.500% 09/02/2026 | USD | 1.086.889,20 | 0,44 |
| 1.000.000 | MEDCO OAK TREE PTE LTD 7.375% 15/05/2026 | USD | 1.064.053,71 | 0,43 |
| 3.400.000 | MEDCO PLATINUM ROAD PTE LTD 6.750% 30/01/2025 | USD | 3.523.195,36 | 1,40 |
| 2.100.000 | MODERNLAND OVERSEAS PTE LTD 6.950% 13/04/2024 | USD | 968.895,48 | 0,39 |
| | | | **14.557.152,67** | **5,84** |
| | **Hongkong** | | | |
| 1.500.000 | BANK OF EAST ASIA LTD/THE FRN PERP | USD | 1.555.171,83 | 0,62 |
| 800.000 | BANK OF EAST ASIA LTD/THE FRN PERP EMTN | USD | 835.563,42 | 0,34 |
| 2.000.000 | CHONG HING BANK LTD FRN PERP EMTN | USD | 2.060.204,70 | 0,83 |
| 4.000.000 | FAR EAST HORIZON LTD FRN PERP EMTN | USD | 4.010.445,12 | 1,60 |
| 1.000.000 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD 7.500% 15/04/2024 | USD | 782.318,12 | 0,31 |
| 1.100.000 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD 7.500% 17/02/2025 | USD | 715.047,31 | 0,29 |
| 550.000 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD 8.250% 25/11/2023 | USD | 370.934,37 | 0,15 |
| | | | **10.329.684,87** | **4,14** |
| | **Philippinen** | | | |
| 1.050.000 | PETRON CORP FRN PERP | USD | 1.049.226,53 | 0,42 |
| 1.500.000 | PETRON CORP FRN PERP | USD | 1.557.076,89 | 0,62 |
| 2.700.000 | SAN MIGUEL CORP FRN PERP EMTN | USD | 2.812.561,38 | 1,13 |
| 1.000.000 | SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP | USD | 1.017.500,00 | 0,41 |
| 1.200.000 | SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP | USD | 1.255.552,25 | 0,50 |
| 1.700.000 | SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP | USD | 1.712.792,08 | 0,69 |
| | | | **9.404.709,13** | **3,77** |
| | **Bermuda** | | | |
| 1.150.000 | CHINA OIL & GAS GROUP LTD 4.700% 30/06/2026 | USD | 1.173.214,49 | 0,47 |
| 4.750.000 | CHINA OIL & GAS GROUP LTD 5.500% 25/01/2023 | USD | 4.849.527,56 | 1,95 |
| | | | **6.022.742,05** | **2,42** |
| | **Australien** | | | |
| 1.100.000 | MACQUARIE BANK LTD/LONDON FRN PERP | USD | 1.203.937,80 | 0,48 |
| 2.700.000 | SCENTRE GROUP TRUST 2 24/09/2080 FRN | USD | 2.912.483,66 | 1,17 |
| | | | **4.116.421,46** | **1,65** |
| | **Indonesien** | | | |
| 662.000 | ALAM SUTERA REALTY TBK 6.000% 02/05/2024 | USD | 573.535,68 | 0,23 |
| 1.987.000 | ALAM SUTERA REALTY TBK 6.250% 02/11/2025 | USD | 1.579.091,91 | 0,63 |
| 550.000 | JAPFA COMFEED INDONESIA TBK PT 5.375% 23/03/2026 | USD | 582.591,49 | 0,23 |
| 500.000 | PAKUWON JATI TBK PT 4.875% 29/04/2028 | USD | 516.513,70 | 0,21 |
| | | | **3.251.732,78** | **1,30** |
| | **Niederlande** | | | |
| 738.750 | GREENKO DUTCH BV 3.850% 29/03/2026 | USD | 751.060,95 | 0,30 |
| 2.000.000 | MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 10/08/2037 | USD | 2.125.405,08 | 0,85 |
| | | | **2.876.466,03** | **1,15** |
| | **Jersey** | | | |
| 2.500.000 | WEST CHINA CEMENT LTD 4.950% 08/07/2026 | USD | 2.435.264,65 | 0,98 |
| | | | **2.435.264,65** | **0,98** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 800.000 | PERIAMA HOLDINGS LLC/DE 5.950% 19/04/2026 | USD | 858.114,78 | 0,34 |
| 900.000 | RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 06/04/2031 | USD | 903.827,26 | 0,37 |
| 600.000 | RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 16/04/2029 | USD | 610.305,14 | 0,24 |
| | | | **2.372.247,18** | **0,95** |
| | **Südkorea** | | | |
| 1.360.000 | HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 1.380.392,37 | 0,55 |
| 800.000 | TONGYANG LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 845.643,51 | 0,34 |
| | | | **2.226.035,88** | **0,89** |
| | **Japan** | | | |
| 1.050.000 | ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 1.070.542,37 | 0,43 |
| 1.000.000 | SOFTBANK GROUP CORP 4.000% 06/07/2026 | USD | 982.250,41 | 0,39 |
| | | | **2.052.792,78** | **0,82** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.500.000 | VEDANTA RESOURCES FINANCE II PLC 13.875% 21/01/2024 | USD | 1.616.672,13 | 0,66 |
| | | | **1.616.672,13** | **0,66** |
| | **Sri Lanka** | | | |
| 1.600.000 | SRILANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024 | USD | 983.646,77 | 0,39 |
| | | | **983.646,77** | **0,39** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Asian High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **China** | | | |
| 1.200.000 | WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD 3.258% 29/10/2030 | USD | 982.084,48 | 0,39 |
| | | | **982.084,48** | **0,39** |
| | | | **230.235.181,07** | **92,33** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **230.235.181,07** | **92,33** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | **Devisentermingeschäfte** | | | |
| 2.538.943,68 | USD | 2.150.000,00 | EUR | 29/10/2021 | 2.538.943,68 | 45.987,75 |
| 2.423.825,78 | USD | 2.061.441,41 | EUR | 19/10/2021 | 2.423.825,78 | 34.012,00 |
| 2.212.122,92 | USD | 2.973.003,92 | SGD | 19/10/2021 | 2.212.122,92 | 22.293,85 |
| 529.584,92 | USD | 723.315,51 | AUD | 19/10/2021 | 529.584,92 | 7.064,57 |
| 325.000,00 | EUR | 383.396,52 | USD | 29/10/2021 | 383.396,52 | (6.554,34) |
| 8.631.384,06 | AUD | 6.364.515,03 | USD | 19/10/2021 | 6.364.515,03 | (129.236,34) |
| 21.336.161,62 | SGD | 15.873.704,80 | USD | 19/10/2021 | 15.873.704,80 | (158.102,59) |
| 29.780.937,66 | EUR | 35.333.637,78 | USD | 19/10/2021 | 35.333.637,78 | (808.817,14) |
| | | | | | **65.659.731,43** | **(993.352,24)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(993.352,24)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **230.235.181,07** | **92,33** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(993.352,24)** | **(0,40)** |
| **Bankguthaben** | **14.479.610,92** | **5,81** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **5.650.443,33** | **2,26** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **249.371.883,08** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Banking & Insurance

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 53.153.855,59 |
| | 30.09.2020 | USD | 38.135.412,45 |
| | 30.09.2019 | USD | 81.557.505,47 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 10.830,93 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.306,17 |
| | 30.09.2019 | EUR | 9.140,55 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.089,63 |
| | 30.09.2020 | USD | 743,66 |
| | 30.09.2019 | USD | 864,82 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 344,12 |
| | 30.09.2020 | EUR | 234,44 |
| | 30.09.2019 | EUR | 296,19 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 928,85 |
| | 30.09.2020 | USD | 640,28 |
| | 30.09.2019 | USD | 752,11 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 279,99 |
| | 30.09.2020 | EUR | 195,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 237,01 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 281,26 |
| | 30.09.2020 | USD | 192,43 |
| | 30.09.2019 | USD | 224,35 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 272,14 |
| | 30.09.2020 | EUR | 188,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 226,85 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.371,69 |
| | 30.09.2020 | EUR | 939,19 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.192,58 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 839,28 |
| | 30.09.2020 | USD | 581,37 |
| | 30.09.2019 | USD | 686,27 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 3.518,12 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.445,16 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.901,58 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 998,52 |
| | 30.09.2020 | EUR | 703,75 |
| | 30.09.2019 | EUR | 860,90 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 266,90 |
| | 30.09.2020 | USD | 185,39 |
| | 30.09.2019 | USD | 219,84 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 67 |
| | 30.09.2020 | 63 |
| | 30.09.2019 | 49 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 91 |
| | 30.09.2020 | 99 |
| | 30.09.2019 | 31.604 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 777 |
| | 30.09.2020 | 149 |
| | 30.09.2019 | 358 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 14.486 |
| | 30.09.2020 | 15.343 |
| | 30.09.2019 | 18.608 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 46.522 |
| | 30.09.2020 | 58.255 |
| | 30.09.2019 | 71.299 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 929 |
| | 30.09.2020 | 1.358 |
| | 30.09.2019 | 1.817 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 2.943 |
| | 30.09.2020 | 3.860 |
| | 30.09.2019 | 5.373 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2.784 |
| | 30.09.2020 | 1.732 |
| | 30.09.2019 | 2.025 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 11.647 |
| | 30.09.2020 | 8.229 |
| | 30.09.2019 | 9.916 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1.313 |
| | 30.09.2020 | 1.420 |
| | 30.09.2019 | 2.016 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 2.837 |
| | 30.09.2020 | 3.364 |
| | 30.09.2019 | 4.144 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 238 |
| | 30.09.2020 | 1.231 |
| | 30.09.2019 | 1.323 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 23,10 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 6,30 |
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 3,25 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Banking & Insurance

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| **Laufende Kosten in %*** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,07% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,04% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 65,68% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Banking & Insurance

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **52.516.656,99** |
| Aktien | | 52.516.656,99 |
| **Bankguthaben** | | **648.847,25** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **628.756,30** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***53.794.260,54*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(348.697,80)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(291.707,15)** |
| Devisentermingeschäfte | | (291.707,15) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(640.404,95)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***53.153.855,59*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **1.107.718,21** |
| Dividenden | | 1.102.900,16 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 4.818,05 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(912.542,78)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (763.092,56) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (120.577,78) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (4.134,75) |
| Abonnementsteuer | 9 | (24.634,48) |
| Bankzinsen | | (103,21) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **195.175,43** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 6.707.120,57 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (847.079,89) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 3.147,90 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (475.289,06) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 203.621,34 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (218.443,33) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 10.295.448,24 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (45.046,96) |
| **Ergebnis** | | **15.818.654,24** |
| Zeichnungen | | 27.209.007,67 |
| Rücknahmen | | (27.950.585,96) |
| Ausschüttung | | (58.632,81) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 38.135.412,45 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***53.153.855,59*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Banking & Insurance

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

#### Vereinigte Staaten

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 209 | AFFILIATED MANAGERS GROUP INC | USD | 31.577,81 | 0,06 |
| 11.400 | AGNC INVESTMENT CORP | USD | 179.778,00 | 0,34 |
| 8.700 | ALLY FINANCIAL INC | USD | 444.135,00 | 0,84 |
| 400 | ARES MANAGEMENT CORP - A | USD | 29.532,00 | 0,06 |
| 800 | ARTISAN PARTNERS ASSET MANAGEMENT INC - A | USD | 39.136,00 | 0,07 |
| 68.844 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 2.922.427,80 | 5,49 |
| 6.691 | BERKSHIRE HATHAWAY INC - B | USD | 1.826.241,54 | 3,44 |
| 1.127 | BLACKROCK INC - A | USD | 945.169,82 | 1,78 |
| 3.000 | BLACKSTONE INC | USD | 349.020,00 | 0,66 |
| 1.200 | BLACKSTONE MORTGAGE TRUST INC - A | USD | 36.384,00 | 0,07 |
| 2.810 | CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | USD | 455.135,70 | 0,86 |
| 12.409 | CITIGROUP INC | USD | 870.863,62 | 1,64 |
| 3.800 | CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | USD | 178.524,00 | 0,34 |
| 1.331 | ERIE INDEMNITY CO - A | USD | 237.477,02 | 0,45 |
| 265 | EVERCORE INC - A | USD | 35.422,55 | 0,07 |
| 16.625 | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC | USD | 753.777,50 | 1,42 |
| 3.778 | GLOBE LIFE INC | USD | 336.355,34 | 0,63 |
| 400 | HOULIHAN LOKEY INC - A | USD | 36.840,00 | 0,07 |
| 19.153 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 3.135.154,57 | 5,89 |
| 3.300 | KKR & CO INC | USD | 200.904,00 | 0,38 |
| 285 | LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | USD | 44.676,60 | 0,08 |
| 10.779 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 1.632.263,97 | 3,07 |
| 2.200 | MGIC INVESTMENT CORP | USD | 32.912,00 | 0,06 |
| 5.655 | MOODY'S CORP | USD | 2.008.147,05 | 3,78 |
| 10.600 | MORGAN STANLEY | USD | 1.031.486,00 | 1,94 |
| 600 | ONEMAIN HOLDINGS INC - A | USD | 33.198,00 | 0,06 |
| 600 | PENNYMAC FINANCIAL SERVICES INC | USD | 36.678,00 | 0,07 |
| 9.670 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 1.891.838,80 | 3,56 |
| 225 | PRIMERICA INC | USD | 34.566,75 | 0,07 |
| 20.673 | PROGRESSIVE CORP/THE | USD | 1.868.632,47 | 3,51 |
| 1.800 | RADIAN GROUP INC | USD | 40.896,00 | 0,08 |
| 5.863 | RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | USD | 541.037,64 | 1,02 |
| 6.369 | S&P GLOBAL INC | USD | 2.706.124,41 | 5,09 |
| 1.600 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC | USD | 39.056,00 | 0,07 |
| 558 | SVB FINANCIAL GROUP | USD | 360.959,04 | 0,68 |
| 16.800 | SYNCHRONY FINANCIAL | USD | 821.184,00 | 1,53 |
| 1.833 | T ROWE PRICE GROUP INC | USD | 360.551,10 | 0,68 |
| 4.800 | TRUIST FINANCIAL CORP | USD | 281.520,00 | 0,53 |
| 12.707 | US BANCORP | USD | 755.304,08 | 1,42 |
| 2.663 | VOYA FINANCIAL INC | USD | 163.481,57 | 0,31 |
| 700 | WEBSTER FINANCIAL CORP | USD | 38.122,00 | 0,07 |
| 342 | WESTERN ALLIANCE BANCORP | USD | 37.216,44 | 0,07 |
| | | | **27.803.708,19** | **52,31** |

#### Kanada

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 3.900 | BANK OF MONTREAL | CAD | 389.276,55 | 0,73 |
| 454 | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT INC - A | CAD | 24.322,52 | 0,05 |
| 3.906 | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | CAD | 434.736,55 | 0,82 |
| 12.000 | MANULIFE FINANCIAL CORP | CAD | 230.935,00 | 0,43 |
| 18.600 | NATIONAL BANK OF CANADA | CAD | 1.428.273,28 | 2,69 |
| 4.200 | ONEX CORP | CAD | 296.852,82 | 0,56 |
| 7.970 | ROYAL BANK OF CANADA | CAD | 792.879,27 | 1,49 |
| 5.700 | SUN LIFE FINANCIAL INC | CAD | 293.357,54 | 0,55 |
| 854 | TMX GROUP LTD | CAD | 92.077,09 | 0,17 |
| 29.932 | TORONTO-DOMINION BANK/THE | CAD | 1.981.132,89 | 3,73 |
| | | | **5.963.843,51** | **11,22** |

#### Vereinigtes Königreich

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 81.100 | ABRDN PLC | GBP | 279.501,62 | 0,53 |
| 277.000 | BARCLAYS PLC | GBP | 708.142,61 | 1,33 |
| 41.400 | DIRECT LINE INSURANCE GROUP PLC | GBP | 161.659,61 | 0,30 |
| 3.800 | HARGREAVES LANSDOWN PLC | GBP | 73.346,19 | 0,14 |
| 1.200 | INTERMEDIATE CAPITAL GROUP PLC | GBP | 33.088,51 | 0,06 |
| 70.300 | M&G PLC | GBP | 192.990,41 | 0,36 |
| 28.600 | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | GBP | 248.961,49 | 0,47 |
| 71.800 | PRUDENTIAL PLC | GBP | 1.408.607,71 | 2,65 |
| 10.700 | ST JAMES'S PLACE PLC | GBP | 217.420,08 | 0,41 |
| | | | **3.323.718,23** | **6,25** |

#### Australien

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 15.500 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD | AUD | 314.241,05 | 0,59 |
| 2.740 | MACQUARIE GROUP LTD | AUD | 359.149,10 | 0,68 |
| 162.800 | MEDIBANK PVT LTD | AUD | 420.922,11 | 0,79 |
| 85.700 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | AUD | 1.717.698,21 | 3,23 |
| | | | **2.812.010,47** | **5,29** |

#### Japan

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 19.800 | ORIX CORP | JPY | 373.324,02 | 0,70 |
| 42.900 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | JPY | 1.511.932,77 | 2,85 |
| | | | **1.885.256,79** | **3,55** |

#### Frankreich

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 18.700 | AXA SA | EUR | 521.978,90 | 0,98 |
| 11.900 | BNP PARIBAS SA | EUR | 764.601,02 | 1,44 |
| 12.800 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 177.213,65 | 0,33 |
| 2.800 | SOCIETE GENERALE SA | EUR | 88.249,41 | 0,17 |
| | | | **1.552.042,98** | **2,92** |

#### Schweiz

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 216 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 339.565,85 | 0,64 |
| 64.400 | UBS GROUP AG - REG | CHF | 1.035.536,26 | 1,94 |
| 300 | VONTOBEL HOLDING AG - REG | CHF | 25.325,62 | 0,05 |
| | | | **1.400.427,73** | **2,63** |

#### Singapur

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 18.000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD | SGD | 400.806,77 | 0,75 |
| 42.700 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD | SGD | 360.627,70 | 0,68 |
| 21.206 | UNITED OVERSEAS BANK LTD | SGD | 402.580,43 | 0,76 |
| | | | **1.164.014,90** | **2,19** |

#### Deutschland

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1.837 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 414.812,63 | 0,78 |
| 2.690 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 738.553,62 | 1,39 |
| | | | **1.153.366,25** | **2,17** |

#### Finnland

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 20.000 | SAMPO OYJ - A | EUR | 994.610,87 | 1,87 |
| | | | **994.610,87** | **1,87** |

#### Schweden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 800 | AVANZA BANK HOLDING AB | SEK | 28.310,98 | 0,05 |
| 6.800 | INDUSTRIVARDEN AB - A | SEK | 218.568,79 | 0,41 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Banking & Insurance

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 12.100 | KINNEVIK AB - B | SEK | 427.581,14 | 0,81 |
| 2.100 | NORDNET AB PUBL | SEK | 37.782,26 | 0,07 |
| 7.700 | SWEDBANK AB -A | SEK | 156.049,86 | 0,29 |
| | | | **868.293,03** | **1,63** |
| | **Niederlande** | | | |
| 33.900 | AEGON NV | EUR | 175.501,30 | 0,33 |
| 700 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 32.061,19 | 0,06 |
| 6.500 | EXOR NV | EUR | 549.319,11 | 1,03 |
| | | | **756.881,60** | **1,42** |
| | **Österreich** | | | |
| 11.400 | ERSTE GROUP BANK AG | EUR | 502.849,85 | 0,95 |
| 8.800 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | EUR | 231.307,87 | 0,44 |
| | | | **734.157,72** | **1,39** |
| | **Irland** | | | |
| 2.126 | AON PLC - A | USD | 607.547,02 | 1,14 |
| | | | **607.547,02** | **1,14** |
| | **Italien** | | | |
| 15.100 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA | EUR | 321.827,66 | 0,61 |
| 900 | BANCA GENERALI SPA | EUR | 39.531,78 | 0,07 |
| 6.300 | FINECOBANK BANCA FINECO SPA | EUR | 114.412,70 | 0,22 |
| 6.300 | MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA | EUR | 76.226,46 | 0,14 |
| | | | **551.998,60** | **1,04** |
| | **Bermuda** | | | |
| 1.500 | ATHENE HOLDING LTD - A | USD | 103.305,00 | 0,19 |
| 54 | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT REINSURANCE PARTNERS LTD - A | CAD | 2.992,30 | 0,01 |
| 400 | BROOKFIELD ASSET MANAGEMENT REINSURANCE PARTNERS LTD - A | USD | 22.224,00 | 0,04 |
| 14.600 | INVESCO LTD | USD | 352.006,00 | 0,66 |
| | | | **480.527,30** | **0,90** |
| | **Hongkong** | | | |
| 13.300 | HANG SENG BANK LTD | HKD | 227.574,81 | 0,43 |
| | | | **227.574,81** | **0,43** |
| | **Norwegen** | | | |
| 6.800 | DNB BANK ASA | NOK | 155.759,09 | 0,30 |
| | | | **155.759,09** | **0,30** |
| | **Spanien** | | | |
| 3.200 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | EUR | 21.202,29 | 0,04 |
| 4.000 | BANKINTER SA | EUR | 23.494,23 | 0,04 |
| | | | **44.696,52** | **0,08** |
| | **Dänemark** | | | |
| 700 | TOPDANMARK AS | DKK | 36.221,38 | 0,07 |
| | | | **36.221,38** | **0,07** |
| | | | **52.516.656,99** | **98,80** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **52.516.656,99** | **98,80** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | **Devisentermingeschäfte** | | | | |
| 435.902,41 | CAD | 292.728,60 | EUR | 19/10/2021 | 344.813,31 | 4.716,88 |
| 1.111.868,27 | EUR | 954.218,33 | GBP | 19/10/2021 | 1.312.299,53 | 2.335,74 |
| 25.849,23 | USD | 22.012,38 | EUR | 19/10/2021 | 25.849,23 | 330,44 |
| 29.560.643,00 | JPY | 228.427,83 | EUR | 19/10/2021 | 269.580,35 | 152,91 |
| 167.943,68 | SEK | 16.479,05 | EUR | 19/10/2021 | 19.203,00 | 94,85 |
| 24.612,87 | CHF | 22.693,70 | EUR | 19/10/2021 | 26.519,63 | 86,16 |
| 25.853,53 | EUR | 192.182,81 | DKK | 19/10/2021 | 30.518,80 | 10,36 |
| 5.753,23 | EUR | 21.821,41 | ILS | 19/10/2021 | 6.791,40 | (94,85) |
| 52.747,55 | GBP | 61.449,12 | EUR | 19/10/2021 | 72.105,90 | (113,99) |
| 45.673,97 | EUR | 469.171,33 | NOK | 19/10/2021 | 53.915,84 | (791,38) |
| 73.405,38 | EUR | 675.973,73 | HKD | 19/10/2021 | 86.732,06 | (1.740,14) |
| 288.347,92 | EUR | 2.940.029,02 | SEK | 19/10/2021 | 340.437,54 | (1.816,88) |
| 469.429,36 | EUR | 509.257,31 | CHF | 19/10/2021 | 553.698,17 | (1.920,32) |
| 898.187,43 | EUR | 1.446.784,33 | AUD | 19/10/2021 | 1.060.529,09 | (3.889,45) |
| 369.158,01 | EUR | 588.291,68 | SGD | 19/10/2021 | 435.772,57 | (5.356,55) |
| 831.091,72 | EUR | 108.351.328,00 | JPY | 19/10/2021 | 981.139,89 | (7.731,48) |
| 2.136.083,72 | EUR | 3.184.003,89 | CAD | 19/10/2021 | 2.521.539,99 | (36.913,97) |
| 9.430.340,25 | EUR | 11.171.589,15 | USD | 19/10/2021 | 11.171.589,15 | (239.065,48) |
| | | | | | **19.313.035,45** | **(291.707,15)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(291.707,15)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **52.516.656,99** | **98,80** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(291.707,15)** | **(0,55)** |
| **Bankguthaben** | **648.847,25** | **1,22** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **280.058,50** | **0,53** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **53.153.855,59** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Belgian Government Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 26.530.454,62 |
| | 30.09.2020 | EUR | 31.352.167,76 |
| | 30.09.2019 | EUR | 33.883.060,64 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.575,86 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.647,35 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.652,57 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.589,69 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.657,83 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.659,10 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.114,88 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.210,81 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.217,80 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.133,40 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.224,84 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.226,54 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 10.163 |
| | 30.09.2020 | | 11.527 |
| | 30.09.2019 | | 12.222 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 482 |
| | 30.09.2020 | | 383 |
| | 30.09.2019 | | 383 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 4.302 |
| | 30.09.2020 | | 4.996 |
| | 30.09.2019 | | 5.564 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | | 305 |
| | 30.09.2020 | | 307 |
| | 30.09.2019 | | 319 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 0,80% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 0,56% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 0,80% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | | 0,56% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 9,41% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Belgian Government Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **25.984.047,45** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 25.984.047,45 |
| **Bankguthaben** | | **343.361,74** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **324.864,61** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***26.652.273,80*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(121.819,18)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(121.819,18)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***26.530.454,62*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **389.620,50** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 389.620,50 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(230.784,33)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (170.385,40) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (43.463,90) |
| Abonnementsteuer | 9 | (14.151,02) |
| Bankzinsen | | (2.784,01) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **158.836,17** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 638.101,61 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (2.085,62) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 126.396,60 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (144.624,25) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (2.055.684,01) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.724,52) |
| **Ergebnis** | | **(1.280.784,02)** |
| Zeichnungen | | 374.209,60 |
| Rücknahmen | | (3.915.138,72) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 31.352.167,76 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***26.530.454,62*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Belgian Government Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Belgien** | | | | |
| 540.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND ZCP 22/10/2027 | EUR | 551.104,08 | 2,08 |
| 990.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.100% 22/06/2030 | EUR | 1.001.994,29 | 3,78 |
| 391.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.200% 22/10/2023 | EUR | 398.149,88 | 1,50 |
| 210.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.650% 22/06/2071 | EUR | 174.311,88 | 0,66 |
| 1.265.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.800% 22/06/2025 | EUR | 1.330.655,18 | 5,02 |
| 513.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.800% 22/06/2027 | EUR | 548.195,58 | 2,07 |
| 1.065.399 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.800% 22/06/2028 | EUR | 1.142.730,81 | 4,31 |
| 1.347.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.900% 22/06/2029 | EUR | 1.457.502,91 | 5,48 |
| 900.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.000% 22/06/2026 | EUR | 963.433,16 | 3,63 |
| 1.183.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.000% 22/06/2031 | EUR | 1.292.168,32 | 4,87 |
| 219.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.250% 22/04/2033 | EUR | 246.199,12 | 0,93 |
| 504.618 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.450% 22/06/2037 | EUR | 580.344,28 | 2,19 |
| 780.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.600% 22/06/2047 | EUR | 917.934,28 | 3,46 |
| 445.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.700% 22/06/2050 | EUR | 535.565,03 | 2,02 |
| 546.794 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.900% 22/06/2038 | EUR | 669.020,82 | 2,52 |
| 507.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.150% 22/06/2066 | EUR | 708.554,85 | 2,67 |
| 830.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.250% 22/06/2023 | EUR | 872.357,06 | 3,29 |
| 360.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.250% 22/06/2057 | EUR | 499.133,83 | 1,88 |
| 930.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.600% 22/06/2024 | EUR | 1.013.291,80 | 3,82 |
| 720.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.000% 22/06/2034 | EUR | 965.761,88 | 3,64 |
| 690.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.750% 22/06/2045 | EUR | 1.139.697,05 | 4,30 |
| 656.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.000% 28/03/2032 | EUR | 924.549,33 | 3,48 |
| 1.110.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.250% 28/03/2041 | EUR | 1.850.514,54 | 6,98 |
| 973.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.250% 28/09/2022 | EUR | 1.020.544,23 | 3,85 |
| 720.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.500% 28/03/2026 | EUR | 885.081,07 | 3,34 |
| 1.420.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.000% 28/03/2035 | EUR | 2.305.703,33 | 8,68 |
| 1.436.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.500% 28/03/2028 | EUR | 1.989.548,86 | 7,49 |
| | | | **25.984.047,45** | **97,94** |
| | | | **25.984.047,45** | **97,94** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **25.984.047,45** | **97,94** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **25.984.047,45** | **97,94** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **0,00** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **343.361,74** | **1,29** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **203.045,43** | **0,77** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **26.530.454,62** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Climate & Environment

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen(1)** | 30.09.2021 | EUR | 218.692.695,21 |
| | 30.09.2020 | EUR | 76.484.270,81 |
| | 30.09.2019 | USD | 52.163.176,31 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 9.565,91 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.385,05 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.165,96 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.946,28 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.520,19 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.180,08 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 371,92 |
| | 30.09.2020 | EUR | 289,98 |
| | 30.09.2019 | EUR | 244,54 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.658,17 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.308,16 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.025,72 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 662,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | 530,18 |
| | 30.09.2019 | EUR | 432,18 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 378,72 |
| | 30.09.2020 | EUR | 293,08 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 343,43 |
| | 30.09.2020 | USD | 268,92 |
| | 30.09.2019 | USD | 209,24 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 341,00 |
| | 30.09.2020 | EUR | 270,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 218,99 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.121,64 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.662,41 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.408,79 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 101.340,90 |
| | 30.09.2020 | HUF | 80.295,43 |
| | 30.09.2019 | HUF | 62.761,83 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.496,80 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.186,59 |
| | 30.09.2019 | USD | 934,81 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 9.713,63 |
| | 30.09.2020 | CZK | 7.585,91 |
| | 30.09.2019 | CZK | 6.400,36 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 366,60 |
| | 30.09.2020 | USD | 293,60 |
| | 30.09.2019 | USD | 233,64 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 64,36 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 373,58 |
| | 30.09.2020 | EUR | 291,27 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.337,56 |
| | 30.09.2020 | USD | 4.999,73 |
| | 30.09.2019 | USD | 3.987,96 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.062,52 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.650,17 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.369,31 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 378,70 |
| | 30.09.2020 | EUR | 293,06 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 329,24 |
| | 30.09.2020 | USD | 257,80 |
| | 30.09.2019 | USD | 250,53 |

| **Anzahl der Anteile** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 647 |
| | 30.09.2020 | 201 |
| | 30.09.2019 | 1.416 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 224 |
| | 30.09.2020 | 357 |
| | 30.09.2019 | 25 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 66.233 |
| | 30.09.2020 | 76.997 |
| | 30.09.2019 | 194 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 13.051 |
| | 30.09.2020 | 10.973 |
| | 30.09.2019 | 9.054 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 6.674 |
| | 30.09.2020 | 8.012 |
| | 30.09.2019 | 10.718 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1.675 |
| | 30.09.2020 | 1.330 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 3.093 |
| | 30.09.2020 | 1.252 |
| | 30.09.2019 | 2.596 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 3.237 |
| | 30.09.2020 | 522 |
| | 30.09.2019 | 1.027 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

(1) Am 1. Dezember 2019 wurde die Basiswährung des Teilfonds NN (L) Climate & Environment von USD auf EUR umgestellt.
**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Climate & Environment

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 5.534 |
| | 30.09.2020 | 2.589 |
| | 30.09.2019 | 709 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 2.280 |
| | 30.09.2020 | 281 |
| | 30.09.2019 | 565 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 25.411 |
| | 30.09.2020 | 13.606 |
| | 30.09.2019 | 19.187 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 56.300 |
| | 30.09.2020 | 11.073 |
| | 30.09.2019 | 7.067 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 110.689 |
| | 30.09.2020 | 10.610 |
| | 30.09.2019 | 15.981 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 753.495 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 20.387 |
| | 30.09.2020 | 26.399 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 460 |
| | 30.09.2020 | 487 |
| | 30.09.2019 | 354 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 397 |
| | 30.09.2020 | 465 |
| | 30.09.2019 | 673 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 744 |
| | 30.09.2020 | 788 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 772 |
| | 30.09.2020 | 1.126 |
| | 30.09.2019 | 1.131 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,07% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 3,30% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (148,54%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

(1) Am 1. Dezember 2019 wurde die Basiswährung des Teilfonds NN (L) Climate & Environment von USD auf EUR umgestellt.
**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Climate & Environment

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **212.695.462,48** |
| Aktien | | 212.695.462,48 |
| **Bankguthaben** | | **6.847.347,22** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **2.609.924,01** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***222.152.733,71*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(3.413.820,01)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(46.218,49)** |
| Devisentermingeschäfte | | (46.218,49) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(3.460.038,50)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***218.692.695,21*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **1.987.787,38** |
| Dividenden | | 1.800.036,75 |
| Sonstige Erträge | 10 | 187.750,63 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(3.924.457,62)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.913.784,76) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (872.098,61) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (3.439,60) |
| Abonnementsteuer | 9 | (101.045,05) |
| Bankzinsen | | (22.901,47) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (11.188,13) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(1.936.670,24)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 13.048.752,19 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.604.203,10) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 354.258,63 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.274,71) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 1.600.681,66 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.576.308,36) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 34.244.345,97 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 70.916,69 |
| **Ergebnis** | | **44.200.498,73** |
| Zeichnungen | | 313.505.668,10 |
| Rücknahmen | | (215.497.742,43) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 76.484.270,81 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***218.692.695,21*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Climate & Environment

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 70.000 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 10.209.931,40 | 4,67 |
| 32.000 | ANSYS INC | USD | 9.400.232,97 | 4,30 |
| 40.000 | DANAHER CORP | USD | 10.507.442,08 | 4,80 |
| 21.000 | ECOLAB INC | USD | 3.780.163,08 | 1,73 |
| 43.000 | IDEX CORP | USD | 7.678.372,66 | 3,51 |
| 46.500 | KADANT INC | USD | 8.189.007,29 | 3,74 |
| 29.500 | MICROSOFT CORP | USD | 7.176.012,77 | 3,28 |
| 38.000 | SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | USD | 8.696.112,86 | 3,98 |
| 20.000 | VERISK ANALYTICS INC - A | USD | 3.456.059,36 | 1,58 |
| 40.500 | WATTS WATER TECHNOLOGIES INC - A | USD | 5.873.976,44 | 2,69 |
| 50.000 | XYLEM INC/NY | USD | 5.335.864,36 | 2,44 |
| 13.000 | ZOETIS INC - A | USD | 2.177.678,07 | 1,00 |
| | | | **82.480.853,34** | **37,72** |
| | **Irland** | | | |
| 27.000 | ACCENTURE PLC - A | USD | 7.453.160,19 | 3,41 |
| 2.500 | KINGSPAN GROUP PLC | EUR | 215.000,00 | 0,10 |
| 65.000 | KINGSPAN GROUP PLC | EUR | 5.590.000,00 | 2,55 |
| 52.000 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | USD | 7.746.494,67 | 3,54 |
| | | | **21.004.654,86** | **9,60** |
| | **Norwegen** | | | |
| 400.000 | ADEVINTA ASA - B | NOK | 5.930.749,77 | 2,71 |
| 58.000 | SALMAR ASA | NOK | 3.334.346,60 | 1,52 |
| 160.000 | TOMRA SYSTEMS ASA | NOK | 7.232.351,65 | 3,31 |
| | | | **16.497.448,02** | **7,54** |
| | **Frankreich** | | | |
| 49.000 | LEGRAND SA | EUR | 4.545.240,00 | 2,08 |
| 60.000 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 8.634.000,00 | 3,95 |
| | | | **13.179.240,00** | **6,03** |
| | **Dänemark** | | | |
| 41.700 | CHR HANSEN HOLDING AS | DKK | 2.940.782,50 | 1,34 |
| 265.000 | VESTAS WIND SYSTEMS AS | DKK | 9.176.715,64 | 4,20 |
| | | | **12.117.498,14** | **5,54** |
| | **Kanada** | | | |
| 160.000 | DESCARTES SYSTEMS GROUP INC | CAD | 11.235.405,36 | 5,14 |
| | | | **11.235.405,36** | **5,14** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 310.000 | HALMA PLC | GBP | 10.249.995,67 | 4,69 |
| | | | **10.249.995,67** | **4,69** |
| | **Färöer-Inseln** | | | |
| 125.000 | BAKKAFROST P/F | NOK | 8.945.547,57 | 4,09 |
| | | | **8.945.547,57** | **4,09** |
| | **Schweiz** | | | |
| 23.000 | SIKA AG - REG | CHF | 6.314.154,55 | 2,89 |
| | | | **6.314.154,55** | **2,89** |
| | **Schweden** | | | |
| 120.000 | ATLAS COPCO AB - A | SEK | 6.298.763,86 | 2,88 |
| | | | **6.298.763,86** | **2,88** |
| | **Spanien** | | | |
| 272.500 | SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA | EUR | 6.000.450,00 | 2,74 |
| | | | **6.000.450,00** | **2,74** |
| | **Niederlande** | | | |
| 62.000 | ALFEN BEHEER BV | EUR | 5.642.000,00 | 2,58 |
| | | | **5.642.000,00** | **2,58** |
| | **Japan** | | | |
| 27.030 | DAIKIN INDUSTRIES LTD | JPY | 5.097.721,11 | 2,33 |
| | | | **5.097.721,11** | **2,33** |
| | **Deutschland** | | | |
| 53.000 | HELLOFRESH SE | EUR | 4.237.880,00 | 1,94 |
| | | | **4.237.880,00** | **1,94** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 51.500 | BEFESA SA | EUR | 3.393.850,00 | 1,55 |
| | | | **3.393.850,00** | **1,55** |
| | | | **212.695.462,48** | **97,26** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **212.695.462,48** | **97,26** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 577.280.313,41 | CZK | 22.713.421,87 | EUR | 19/10/2021 | 22.713.421,87 | 46.324,10 |
| 198.068,19 | USD | 169.381,49 | EUR | 19/10/2021 | 169.381,49 | 1.471,23 |
| 879.320,72 | NOK | 86.420,87 | EUR | 19/10/2021 | 86.420,87 | 460,69 |
| 338.672,54 | EUR | 290.907,20 | GBP | 19/10/2021 | 338.672,54 | 317,87 |
| 529.328,41 | EUR | 3.934.932,95 | DKK | 19/10/2021 | 529.328,41 | 161,62 |
| 28.703,87 | CAD | 19.407,36 | EUR | 19/10/2021 | 19.407,36 | 136,55 |
| 328.107,15 | SEK | 32.234,08 | EUR | 19/10/2021 | 32.234,08 | 120,45 |
| 30.876,61 | GBP | 35.830,80 | EUR | 19/10/2021 | 35.830,80 | 81,85 |
| 11.350,05 | CHF | 10.470,38 | EUR | 19/10/2021 | 10.470,38 | 28,93 |
| 1.449,65 | EUR | 2.335,96 | AUD | 19/10/2021 | 1.449,65 | (5,97) |
| 1.151.567,40 | DKK | 154.890,41 | EUR | 19/10/2021 | 154.890,41 | (28,50) |
| 3.652.157,00 | JPY | 28.276,67 | EUR | 19/10/2021 | 28.276,67 | (38,57) |
| 200.677,96 | EUR | 218.222,76 | CHF | 19/10/2021 | 200.677,96 | (1.188,02) |
| 215.705,64 | EUR | 2.200.725,76 | SEK | 19/10/2021 | 215.705,64 | (1.307,16) |
| 181.378,39 | EUR | 23.650.896,00 | JPY | 19/10/2021 | 181.378,39 | (1.487,86) |
| 342.042,48 | EUR | 509.951,38 | CAD | 19/10/2021 | 342.042,48 | (5.173,59) |

(1) Am 1. Dezember 2019 wurde die Basiswährung des Teilfonds NN (L) Climate & Environment von USD auf EUR umgestellt.
**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Climate & Environment

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1.117.051,72 | EUR | 28.516.565,47 | CZK | 19/10/2021 | 1.117.051,72 | (7.237,07) |
| 832.143,93 | EUR | 8.547.934,75 | NOK | 19/10/2021 | 832.143,93 | (12.437,46) |
| 3.038.210,55 | EUR | 3.599.170,55 | USD | 19/10/2021 | 3.038.210,55 | (66.417,58) |
| | | | | | **30.046.995,20** | **(46.218,49)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(46.218,49)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **212.695.462,48** | **97,26** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(46.218,49)** | **(0,02)** |
| **Bankguthaben** | **6.847.347,22** | **3,13** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(803.896,00)** | **(0,37)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **218.692.695,21** | **100,00** |

(1) Am 1. Dezember 2019 wurde die Basiswährung des Teilfonds NN (L) Climate & Environment von USD auf EUR umgestellt.
**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Commodity Enhanced

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 196.340.104,45 |
| | 30.09.2020 | USD | 179.481.656,31 |
| | 30.09.2019 | USD | 225.295.082,67 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.585,51 |
| | 30.09.2020 | USD | 3.267,90 |
| | 30.09.2019 | USD | 3.288,18 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 3.151,21 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.273,25 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.343,26 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 109,81 |
| | 30.09.2020 | GBP | - |
| | 30.09.2019 | GBP | - |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 26.965,05 |
| | 30.09.2020 | PLN | 19.322,13 |
| | 30.09.2019 | PLN | - |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 169,21 |
| | 30.09.2020 | EUR | 122,29 |
| | 30.09.2019 | EUR | 126,46 |
| Capitalisation O Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 170,89 |
| | 30.09.2020 | EUR | 123,08 |
| | 30.09.2019 | EUR | 126,78 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 162,44 |
| | 30.09.2020 | EUR | 117,94 |
| | 30.09.2019 | EUR | 122,28 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 171,61 |
| | 30.09.2020 | USD | 123,55 |
| | 30.09.2019 | USD | 125,49 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 268,30 |
| | 30.09.2020 | CZK | 194,32 |
| | 30.09.2019 | CZK | 202,45 |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.644,11 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.044,12 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.143,98 |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.306,32 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.521,01 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.624,52 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 288 |
| | 30.09.2020 | | 42.992 |
| | 30.09.2019 | | 33.210 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 2.767 |
| | 30.09.2020 | 774 |
| | 30.09.2019 | 1.717 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 100.784 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 18.577 |
| | 30.09.2020 | 133 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 11.597 |
| | 30.09.2020 | 9.889 |
| | 30.09.2019 | 10.374 |
| Capitalisation O Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 16.787 |
| | 30.09.2020 | 19.567 |
| | 30.09.2019 | 75.363 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 11.084 |
| | 30.09.2020 | 14.096 |
| | 30.09.2019 | 15.731 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 43.681 |
| | 30.09.2020 | 1.479 |
| | 30.09.2019 | 1.225 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 1.321.691 |
| | 30.09.2020 | 1.194.304 |
| | 30.09.2019 | 815.072 |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 809 |
| | 30.09.2020 | 944 |
| | 30.09.2019 | 998 |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 979 |
| | 30.09.2020 | 2.897 |
| | 30.09.2019 | 17.084 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Commodity Enhanced

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| **Laufende Kosten in %*** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,71% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,73% |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,73% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,73% |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,87% |
| Capitalisation O Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,67% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,37% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,65% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 1,67% |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,23% |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,01% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (197,15%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Commodity Enhanced

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **163.466.904,62** |
| Geldmarktinstrumente | | 163.466.904,62 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **7.848.665,08** |
| Rohstoff-Swaps | | 4.054.363,37 |
| Total Return Swaps | | 3.794.301,71 |
| **Bankguthaben** | | **27.018.116,44** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **29.965.702,20** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***228.299.388,34*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(25.330.747,00)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(6.628.536,89)** |
| Devisentermingeschäfte | | (6.628.536,89) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(31.959.283,89)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***196.340.104,45*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **299.593,22** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 281.532,54 |
| Bankzinsen | | 18.060,68 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.461.912,15)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.022.544,43) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (390.077,24) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (19.363,96) |
| Abonnementsteuer | 9 | (28.458,86) |
| Bankzinsen | | (291,67) |
| Zinsen auf Swaps | | (200,00) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (975,99) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(1.162.318,93)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 5.443,86 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (37.470,87) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 66.738.740,91 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (13.796.395,49) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 643.261,09 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (634.081,66) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (164.551,90) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 9.115.352,84 |
| **Ergebnis** | | **60.707.979,85** |
| Zeichnungen | | 173.887.809,96 |
| Rücknahmen | | (217.737.341,67) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 179.481.656,31 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***196.340.104,45*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Commodity Enhanced

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 15.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 02/11/2021 | USD | 14.999.402,10 | 7,64 |
| 15.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 03/03/2022 | USD | 14.997.520,95 | 7,64 |
| 40.500.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 04/11/2021 | USD | 40.497.270,30 | 20,63 |
| 35.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 08/09/2022 | USD | 34.975.061,45 | 17,81 |
| 20.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 14/10/2021 | USD | 19.999.857,00 | 10,19 |
| 10.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 18/11/2021 | USD | 9.999.670,90 | 5,09 |
| 18.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 19/10/2021 | USD | 17.999.432,82 | 9,17 |
| 10.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 27/01/2022 | USD | 9.998.689,10 | 5,09 |
| | | | **163.466.904,62** | **83,26** |
| | | | **163.466.904,62** | **83,26** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **163.466.904,62** | **83,26** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl | Bezeich-nung | Fälligkeits-datum | Währung | Nennwert | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|
| **Rohstoff-Swap** | | | | | |
| 1.045.997 | COMMODITY ENHANCED CURVE INDEX | 31/01/2022 | USD | 97.339.745,14 | 4.054.363,37 |
| | | | | | **4.054.363,37** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Fälligkeits-datum | Währung | Nennwert | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|
| **Total Return Swap** | | | | | |
| 965.447 | TRS COMMODITY ENHANCED CURVE INDEX | 31/01/2022 | USD | 91.094.927,64 | 3.794.301,71 |
| | | | | | **3.794.301,71** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 664.473,36 | USD | 561.013,37 | EUR | 19/10/2021 | 664.473,36 | 14.094,72 |
| 119.158,55 | USD | 86.573,30 | GBP | 19/10/2021 | 119.158,55 | 2.425,21 |
| 248.535,63 | USD | 213.968,94 | EUR | 04/10/2021 | 248.535,63 | 556,33 |
| 35.654,06 | USD | 773.806,95 | CZK | 19/10/2021 | 35.654,06 | 286,40 |
| 48.124,41 | CZK | 2.192,25 | USD | 04/10/2021 | 2.192,25 | 8,51 |
| 792,30 | USD | 678,72 | EUR | 01/10/2021 | 792,30 | 5,70 |
| 161.193,96 | CZK | 7.375,88 | USD | 01/10/2021 | 7.375,88 | (4,41) |
| 7.637,03 | EUR | 8.870,79 | USD | 04/10/2021 | 8.870,79 | (19,85) |
| 10.108,47 | EUR | 11.800,12 | USD | 01/10/2021 | 11.800,12 | (84,91) |
| 245.167,20 | USD | 182.619,89 | GBP | 04/10/2021 | 245.167,20 | (1.068,39) |
| 10.730.713,07 | GBP | 14.788.377,93 | USD | 19/10/2021 | 14.788.377,93 | (319.343,96) |
| 342.215.514,86 | CZK | 15.974.335,19 | USD | 19/10/2021 | 15.974.335,19 | (333.016,74) |
| 25.951.577,49 | EUR | 30.778.868,29 | USD | 19/10/2021 | 30.778.868,29 | (693.396,55) |
| 481.686.324,22 | PLN | 126.589.637,90 | USD | 19/10/2021 | 126.589.637,90 | (5.298.978,95) |
| | | | | | **189.475.239,45** | **(6.628.536,89)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **1.220.128,19** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **163.466.904,62** | **83,26** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **1.220.128,19** | **0,62** |
| **Bankguthaben** | **27.018.116,44** | **13,76** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **4.634.955,20** | **2,36** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **196.340.104,45** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Corporate Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 518.646.666,95 |
| | 30.09.2020 | EUR | 417.602.509,58 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.062,89 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.996,66 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 252,96 |
| | 30.09.2020 | EUR | 249,82 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 249,57 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.135,12 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.069,24 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 94.761 |
| | 30.09.2020 | | 76.571 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 50.188 |
| | 30.09.2020 | | 78.020 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 131 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | | 5.093 |
| | 30.09.2020 | | 3.060 |
| | 30.09.2019 | | - |
| **Dividende** | | | |
| Distribution I (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 1,30 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,33% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 0,40% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 0,95% |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,33% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 16,48% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Corporate Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **508.100.505,36** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 508.100.505,36 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **607.931,13** |
| Futures | | 607.931,13 |
| **Bankguthaben** | | **7.651.315,65** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **91.627,44** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **2.638.455,07** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***519.089.834,65*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(330.169,67)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(112.998,03)** |
| Devisentermingeschäfte | | (112.998,03) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(443.167,70)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***518.646.666,95*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **2.782.501,13** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 2.778.788,44 |
| Sonstige Erträge | 10 | 3.712,69 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.632.017,71)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (951.175,98) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (576.899,98) |
| Abonnementsteuer | 9 | (56.898,27) |
| Bankzinsen | | (47.043,48) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **1.150.483,42** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 605.576,79 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (14.762,88) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 2.657.383,83 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (2.864.367,55) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 91.018,84 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (71.777,32) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 3.314.642,36 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 493.790,23 |
| **Ergebnis** | | **5.361.987,72** |
| Zeichnungen | | 130.013.433,20 |
| Rücknahmen | | (34.327.229,77) |
| Ausschüttung | | (4.033,78) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 417.602.509,58 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***518.646.666,95*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Corporate Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Niederlande** | | | |
| 6.500.000 | ABN AMRO BANK NV 0.500% 15/04/2026 EMTN | EUR | 6.661.658,90 | 1,28 |
| 2.900.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.250% 30/10/2026 | EUR | 2.932.952,24 | 0,57 |
| 2.000.000 | CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN | EUR | 2.025.763,62 | 0,39 |
| 4.471.000 | CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN | EUR | 4.486.681,09 | 0,87 |
| 1.750.000 | CTP NV 1.250% 21/06/2029 EMTN | EUR | 1.758.930,32 | 0,34 |
| 2.114.000 | CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN | EUR | 2.091.766,01 | 0,40 |
| 6.800.000 | DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN | EUR | 6.847.788,84 | 1,32 |
| 6.200.000 | DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN | EUR | 6.505.525,77 | 1,25 |
| 2.700.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 0.625% 15/07/2025 | EUR | 2.752.817,45 | 0,53 |
| 2.910.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032 | EUR | 2.852.180,28 | 0,55 |
| 6.639.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030 | EUR | 6.973.520,16 | 1,34 |
| 3.000.000 | DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031 | EUR | 2.869.399,77 | 0,55 |
| 2.833.000 | EDP FINANCE BV 0.375% 16/09/2026 EMTN | EUR | 2.865.235,77 | 0,55 |
| 4.945.000 | EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN | EUR | 5.316.856,63 | 1,03 |
| 8.836.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.000% 16/09/2024 EMTN | EUR | 9.128.606,53 | 1,76 |
| 7.233.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN | EUR | 7.589.993,61 | 1,46 |
| 1.591.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.500% 21/07/2025 EMTN | EUR | 1.680.262,72 | 0,32 |
| 6.388.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 19/10/2027 EMTN | EUR | 6.777.602,27 | 1,31 |
| 3.200.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 3.459.969,06 | 0,67 |
| 5.000.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 5.019.116,85 | 0,97 |
| 6.400.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 6.538.336,32 | 1,26 |
| 2.700.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP EMTN | EUR | 2.841.586,27 | 0,55 |
| 900.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV 0.375% 15/09/2025 EMTN | EUR | 917.431,33 | 0,18 |
| 3.000.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.125% 21/04/2026 EMTN | EUR | 3.165.165,69 | 0,61 |
| 5.200.000 | ING GROEP NV 01/07/2026 FRN | USD | 4.495.947,55 | 0,87 |
| 1.100.000 | ING GROEP NV 09/06/2032 FRN EMTN | EUR | 1.100.868,35 | 0,21 |
| 7.700.000 | ING GROEP NV 2.500% 15/11/2030 EMTN | EUR | 9.084.496,42 | 1,75 |
| 3.000.000 | LEASEPLAN CORP NV 1.375% 07/03/2024 EMTN | EUR | 3.111.174,93 | 0,60 |
| 2.500.000 | LEASEPLAN CORP NV 3.500% 09/04/2025 EMTN | EUR | 2.797.164,23 | 0,54 |
| 5.900.000 | NATURGY FINANCE BV 0.875% 15/05/2025 EMTN | EUR | 6.089.592,31 | 1,17 |
| 1.533.000 | SWISSCOM FINANCE BV 0.375% 14/11/2028 | EUR | 1.553.400,12 | 0,30 |
| 500.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 510.930,26 | 0,10 |
| 598.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 630.206,58 | 0,12 |
| 3.800.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 3.982.413,26 | 0,77 |
| 4.672.000 | VESTEDA FINANCE BV 1.500% 24/05/2027 EMTN | EUR | 4.983.790,55 | 0,96 |
| 1.500.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0.875% 22/09/2028 EMTN | EUR | 1.545.055,26 | 0,30 |
| 4.300.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.250% 23/09/2032 EMTN | EUR | 4.460.032,67 | 0,86 |
| | | | **148.404.219,99** | **28,61** |
| | **Frankreich** | | | |
| 3.188.000 | AXA SA 07/10/2041 FRN EMTN | EUR | 3.188.424,93 | 0,61 |
| 2.500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN | EUR | 2.486.796,28 | 0,48 |
| 7.000.000 | BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN | EUR | 7.103.709,55 | 1,37 |
| 4.400.000 | BNP PARIBAS SA 1.125% 28/08/2024 EMTN | EUR | 4.558.018,34 | 0,88 |
| 6.300.000 | BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN | EUR | 6.318.379,31 | 1,22 |
| 7.300.000 | CNP ASSURANCES 27/07/2050 FRN | EUR | 7.623.943,49 | 1,47 |
| 2.900.000 | COVIVIO 1.125% 17/09/2031 | EUR | 3.027.707,33 | 0,58 |
| 700.000 | COVIVIO 1.875% 20/05/2026 | EUR | 759.931,47 | 0,15 |
| 11.700.000 | CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 21/10/2025 EMTN | EUR | 11.852.149,61 | 2,28 |
| 400.000 | ENGIE SA FRN PERP | EUR | 432.000,00 | 0,08 |
| 1.100.000 | ENGIE SA FRN PERP | EUR | 1.115.092,83 | 0,22 |
| 1.500.000 | ENGIE SA FRN PERP | EUR | 1.507.747,68 | 0,29 |
| 1.400.000 | ENGIE SA 0.375% 21/06/2027 EMTN | EUR | 1.416.933,67 | 0,27 |
| 1.900.000 | ENGIE SA 1.375% 21/06/2039 EMTN | EUR | 1.991.260,69 | 0,38 |
| 4.200.000 | ENGIE SA 1.375% 28/02/2029 EMTN | EUR | 4.509.619,51 | 0,87 |
| 3.400.000 | ENGIE SA 1.750% 27/03/2028 EMTN | EUR | 3.712.441,81 | 0,72 |
| 1.735.000 | FAURECIA SE 2.375% 15/06/2029 | EUR | 1.753.188,18 | 0,34 |
| 7.000.000 | GECINA SA 0.875% 30/06/2036 EMTN | EUR | 7.010.235,89 | 1,35 |
| 3.300.000 | LA BANQUE POSTALE SA 1.375% 24/04/2029 EMTN | EUR | 3.501.965,54 | 0,68 |
| 1.400.000 | LA POSTE SA 1.450% 30/11/2028 EMTN | EUR | 1.524.311,10 | 0,29 |
| 1.100.000 | SOCIETE GENERALE SA 22/09/2028 FRN | EUR | 1.117.785,48 | 0,22 |
| 584.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.000% 14/03/2025 EMTN | EUR | 607.915,64 | 0,12 |
| | | | **77.119.558,33** | **14,87** |
| | **Spanien** | | | |
| 2.700.000 | ACS SERVICIOS COMUNICACIONES Y ENERGIA SA 1.875% 20/04/2026 | EUR | 2.851.738,97 | 0,55 |
| 9.300.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.000% 21/06/2026 | EUR | 9.684.532,22 | 1,87 |
| 7.900.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.375% 14/05/2025 GMTN | EUR | 8.287.545,80 | 1,60 |
| 3.200.000 | BANCO DE SABADELL SA 11/03/2027 FRN | EUR | 3.291.765,89 | 0,63 |
| 2.200.000 | BANCO DE SABADELL SA 16/06/2028 FRN EMTN | EUR | 2.165.967,47 | 0,42 |
| 4.300.000 | BANCO SANTANDER SA 0.300% 04/10/2026 EMTN | EUR | 4.337.537,50 | 0,84 |
| 8.700.000 | BANCO SANTANDER SA 1.125% 23/06/2027 EMTN | EUR | 9.062.093,30 | 1,75 |
| 3.100.000 | BANCO SANTANDER SA 24/06/2029 FRN EMTN | EUR | 3.107.764,29 | 0,60 |
| 2.600.000 | CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN | EUR | 2.566.842,38 | 0,49 |
| 2.500.000 | CAIXABANK SA 18/06/2031 FRN EMTN | EUR | 2.530.926,43 | 0,49 |
| 2.200.000 | CAIXABANK SA 18/11/2026 FRN EMTN | EUR | 2.207.773,22 | 0,43 |
| 800.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 0.875% 16/06/2025 EMTN | EUR | 828.364,18 | 0,16 |
| 1.300.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 1.250% 13/09/2027 EMTN | EUR | 1.393.440,59 | 0,27 |
| 4.000.000 | RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU 0.375% 24/07/2028 EMTN | EUR | 4.067.062,36 | 0,78 |
| 3.300.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.069% 05/02/2024 EMTN | EUR | 3.391.154,18 | 0,65 |
| | | | **59.774.508,78** | **11,53** |
| | **Deutschland** | | | |
| 1.600.000 | ADIDAS AG ZCP 05/10/2028 | EUR | 1.588.574,85 | 0,31 |
| 1.000.000 | BERLIN HYP AG 0.500% 26/09/2023 EMTN | EUR | 1.013.522,90 | 0,20 |
| 900.000 | BERLIN HYP AG 1.125% 25/10/2027 EMTN | EUR | 946.432,65 | 0,18 |
| 1.100.000 | COMMERZBANK AG 24/03/2026 FRN EMTN | EUR | 1.121.861,31 | 0,22 |
| 6.095.000 | DAIMLER AG 0.750% 10/09/2030 EMTN | EUR | 6.261.016,52 | 1,21 |
| 7.171.000 | DAIMLER AG 0.750% 11/03/2033 EMTN | EUR | 7.196.275,12 | 1,39 |
| 2.100.000 | DEUTSCHE WOHNEN SE 1.300% 07/04/2041 EMTN | EUR | 2.087.227,97 | 0,40 |
| 2.600.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/08/2079 FRN | EUR | 2.641.109,77 | 0,51 |
| 3.500.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/11/2079 FRN | EUR | 3.539.336,99 | 0,68 |
| 300.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 31/08/2081 FRN | EUR | 296.463,83 | 0,06 |
| 4.891.000 | E.ON SE ZCP 28/08/2024 EMTN | EUR | 4.915.566,71 | 0,95 |
| 9.940.000 | E.ON SE 0.375% 29/09/2027 EMTN | EUR | 10.058.546,63 | 1,93 |
| 4.900.000 | E.ON SE 0.875% 20/08/2031 EMTN | EUR | 5.043.667,27 | 0,97 |
| 745.000 | E.ON SE 1.000% 07/10/2025 EMTN | EUR | 774.348,96 | 0,15 |
| 8.800.000 | EUROGRID GMBH 1.113% 15/05/2032 EMTN | EUR | 9.247.421,39 | 1,77 |
| 2.300.000 | ZF FINANCE GMBH 2.000% 06/05/2027 EMTN | EUR | 2.311.676,32 | 0,45 |
| | | | **59.043.049,19** | **11,38** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Corporate Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Italien** | | | |
| 2.475.000 | ACEA SPA 0.250% 28/07/2030 EMTN | EUR | 2.398.548,14 | 0,46 |
| 6.837.000 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.124% 01/10/2030 EMTN | EUR | 7.277.321,40 | 1,41 |
| 3.900.000 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.429% 14/07/2031 EMTN | EUR | 4.212.000,00 | 0,81 |
| 1.602.000 | ERG SPA 0.875% 15/09/2031 EMTN | EUR | 1.598.613,37 | 0,31 |
| 5.266.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 04/12/2024 EMTN | EUR | 5.396.318,49 | 1,04 |
| 4.117.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN | EUR | 4.168.041,41 | 0,80 |
| 4.340.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 1.625% 18/01/2029 EMTN | EUR | 4.252.686,97 | 0,82 |
| | | | **29.303.529,78** | **5,65** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 3.000.000 | CPI PROPERTY GROUP SA 1.625% 23/04/2027 EMTN | EUR | 3.148.136,01 | 0,61 |
| 1.800.000 | CPI PROPERTY GROUP SA 2.750% 12/05/2026 EMTN | EUR | 1.973.934,18 | 0,38 |
| 5.771.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 0.875% 09/07/2029 EMTN | EUR | 5.929.264,25 | 1,13 |
| 2.445.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN | EUR | 2.623.412,04 | 0,51 |
| 1.045.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.750% 15/03/2028 EMTN | EUR | 1.136.095,71 | 0,22 |
| 1.754.000 | SEGRO CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031 | EUR | 1.716.668,93 | 0,33 |
| 5.372.000 | SELP FINANCE SARL 0.875% 27/05/2029 | EUR | 5.383.775,64 | 1,04 |
| | | | **21.911.286,76** | **4,22** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 8.990.000 | HSBC HOLDINGS PLC 04/12/2024 FRN EMTN | EUR | 9.308.936,25 | 1,79 |
| 8.333.000 | NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANSMISSION PLC 0.190% 20/01/2025 | EUR | 8.391.974,56 | 1,62 |
| 684.000 | NATIONAL GRID PLC 0.250% 01/09/2028 EMTN | EUR | 676.536,42 | 0,13 |
| 3.000.000 | SSE PLC 0.875% 06/09/2025 EMTN | EUR | 3.088.064,67 | 0,60 |
| | | | **21.465.511,90** | **4,14** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 3.000.000 | APPLE INC 0.500% 15/11/2031 | EUR | 3.042.521,58 | 0,59 |
| 3.822.000 | DIGITAL EURO FINCO LLC 2.500% 16/01/2026 | EUR | 4.174.353,93 | 0,80 |
| 2.500.000 | EQUINIX INC 0.250% 15/03/2027 | EUR | 2.497.825,20 | 0,48 |
| 2.750.000 | EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033 | EUR | 2.733.361,07 | 0,53 |
| 780.000 | PEPSICO INC 2.875% 15/10/2049 | USD | 685.371,41 | 0,13 |
| 1.924.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.875% 08/02/2029 | USD | 1.863.230,30 | 0,36 |
| 3.630.000 | VF CORP 0.250% 25/02/2028 | EUR | 3.613.436,09 | 0,70 |
| | | | **18.610.099,58** | **3,59** |
| | **Finnland** | | | |
| 3.114.000 | NORDEA BANK ABP 0.375% 28/05/2026 EMTN | EUR | 3.181.858,42 | 0,61 |
| 2.364.000 | NORDEA BANK ABP 0.500% 19/03/2031 EMTN | EUR | 2.365.912,78 | 0,46 |
| 2.430.000 | STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN | EUR | 2.431.374,31 | 0,47 |
| 5.670.000 | UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN | EUR | 5.574.955,77 | 1,07 |
| | | | **13.554.101,28** | **2,61** |
| | **Irland** | | | |
| 7.421.000 | AIB GROUP PLC 17/11/2027 FRN EMTN | EUR | 7.450.398,37 | 1,44 |
| 3.084.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 10/05/2027 FRN EMTN | EUR | 3.072.465,72 | 0,59 |
| 1.797.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033 | EUR | 1.787.118,93 | 0,34 |
| | | | **12.309.983,02** | **2,37** |
| | **Belgien** | | | |
| 10.700.000 | KBC GROUP NV 16/06/2027 FRN EMTN | EUR | 10.808.144,04 | 2,08 |
| | | | **10.808.144,04** | **2,08** |
| | **Österreich** | | | |
| 4.900.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.375% 25/09/2026 EMTN | EUR | 4.972.104,68 | 0,96 |
| 800.000 | VERBUND AG 0.900% 01/04/2041 | EUR | 804.217,69 | 0,16 |
| | | | **5.776.322,37** | **1,12** |
| | **Südkorea** | | | |
| 3.000.000 | LG CHEM LTD 0.500% 15/04/2023 | EUR | 3.024.875,88 | 0,58 |
| 1.403.000 | LG CHEM LTD 3.625% 15/04/2029 | USD | 1.327.702,58 | 0,26 |
| 930.000 | SK HYNIX INC 2.375% 19/01/2031 | USD | 780.119,24 | 0,15 |
| | | | **5.132.697,70** | **0,99** |
| | **Portugal** | | | |
| 4.600.000 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 1.625% 15/04/2027 EMTN | EUR | 4.930.414,92 | 0,95 |
| | | | **4.930.414,92** | **0,95** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 3.800.000 | CESKA SPORITELNA AS 13/09/2028 FRN EMTN | EUR | 3.792.895,75 | 0,73 |
| | | | **3.792.895,75** | **0,73** |
| | **Schweden** | | | |
| 610.000 | SKF AB 0.875% 15/11/2029 EMTN | EUR | 632.474,85 | 0,12 |
| 2.000.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.010% 02/12/2027 EMTN | EUR | 1.971.898,54 | 0,38 |
| 850.000 | TELIA CO AB 11/05/2081 FRN | EUR | 867.082,66 | 0,17 |
| | | | **3.471.456,05** | **0,67** |
| | **Japan** | | | |
| 3.093.000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.848% 19/07/2029 | EUR | 3.183.512,75 | 0,61 |
| | | | **3.183.512,75** | **0,61** |
| | **Türkei** | | | |
| 2.588.000 | ARCELIK AS 3.000% 27/05/2026 | EUR | 2.625.007,21 | 0,51 |
| | | | **2.625.007,21** | **0,51** |
| | **Dänemark** | | | |
| 979.000 | ORSTED AS 1.500% 26/11/2029 | EUR | 1.066.311,27 | 0,21 |
| 845.000 | ORSTED AS 24/11/3017 FRN | EUR | 885.226,55 | 0,17 |
| | | | **1.951.537,82** | **0,38** |
| | **Hongkong** | | | |
| 2.050.000 | MTR CORP LTD 1.625% 19/08/2030 EMTN | USD | 1.720.365,37 | 0,33 |
| | | | **1.720.365,37** | **0,33** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 1.268.000 | FIBRIA OVERSEAS FINANCE LTD 5.500% 17/01/2027 | USD | 1.251.343,27 | 0,24 |
| | | | **1.251.343,27** | **0,24** |
| | **Mexiko** | | | |
| 1.215.000 | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV 1.850% 01/09/2032 | USD | 993.543,94 | 0,19 |
| | | | **993.543,94** | **0,19** |
| | **Indien** | | | |
| 963.000 | POWER FINANCE CORP LTD 1.841% 21/09/2028 GMTN | EUR | 967.415,56 | 0,20 |
| | | | **967.415,56** | **0,20** |
| | | | **508.100.505,36** | **97,97** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **508.100.505,36** | **97,97** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Corporate Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäft** | | | | | | |
| 13.367.638,27 | EUR | 15.631.000,00 | USD | 29/10/2021 | 13.367.638,27 | (112.998,03) |
| | | | | | **13.367.638,27** | **(112.998,03)** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| 192 | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 25.906.560,00 | (142.180,00) |
| (201) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 34.133.820,00 | 582.644,44 |
| (4) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 813.360,00 | 27.040,00 |
| (4) | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 659.433,11 | 18.254,67 |
| (19) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 2.157.623,82 | 24.591,23 |
| (35) | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 4.386.513,65 | 69.362,91 |
| 1 | US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 189.874,19 | (94,37) |
| (50) | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 5.295.404,81 | 28.312,25 |
| | | | **73.542.589,58** | **607.931,13** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **494.933,10** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **508.100.505,36** | **97,97** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **494.933,10** | **0,10** |
| **Bankguthaben** | **7.651.315,65** | **1,48** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **2.399.912,84** | **0,45** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **518.646.666,95** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Europe Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 41.676.380,95 |
| | 30.09.2020 | EUR | 33.366.723,82 |
| | 30.09.2019 | EUR | 50.641.891,56 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 95,06 |
| | 30.09.2020 | EUR | 65,73 |
| | 30.09.2019 | EUR | 83,11 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 83,07 |
| | 30.09.2020 | EUR | 58,01 |
| | 30.09.2019 | EUR | 74,08 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 320,90 |
| | 30.09.2020 | EUR | 222,43 |
| | 30.09.2019 | EUR | 281,93 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 75,18 |
| | 30.09.2020 | EUR | 52,76 |
| | 30.09.2019 | EUR | 67,72 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 106,37 |
| | 30.09.2020 | USD | 75,53 |
| | 30.09.2019 | USD | 90,11 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.890,11 |
| | 30.09.2020 | EUR | 3.465,22 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.570,22 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 292,38 |
| | 30.09.2020 | EUR | 207,21 |
| | 30.09.2019 | EUR | 272,95 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 110.306 |
| | 30.09.2020 | | 127.250 |
| | 30.09.2019 | | 192.811 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 127.865 |
| | 30.09.2020 | | 135.255 |
| | 30.09.2019 | | 165.872 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 2.444 |
| | 30.09.2020 | | 2.840 |
| | 30.09.2019 | | 2.988 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 245.956 |
| | 30.09.2020 | | 284.811 |
| | 30.09.2019 | | 288.801 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | | 5.041 |
| | 30.09.2020 | | 8.191 |
| | 30.09.2019 | | 6.131 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 164 |
| | 30.09.2020 | | 261 |
| | 30.09.2019 | | 279 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | | 101 |
| | 30.09.2020 | | 320 |
| | 30.09.2019 | | 538 |
| **Dividende** | | | |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 58,85 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 5,35 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,91% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 1,90% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 1,15% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 2,40% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | | 2,40% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 1,90% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | | 1,14% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 87,96% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Europe Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **41.248.964,22** |
| Aktien | | 41.248.964,22 |
| **Bankguthaben** | | **422.323,29** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **440.224,85** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***42.111.512,36*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(435.131,41)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(435.131,41)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***41.676.380,95*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **1.588.129,57** |
| Dividenden | | 1.579.186,82 |
| Sonstige Erträge | 10 | 8.942,75 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(730.742,26)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (578.860,50) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (130.760,57) |
| Abonnementsteuer | 9 | (15.832,38) |
| Bankzinsen | | (2.047,59) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (3.241,22) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **857.387,31** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 6.699.183,58 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (3.604.614,20) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 277.196,15 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (289.246,98) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 9.605.762,73 |
| **Ergebnis** | | **13.545.668,59** |
| Zeichnungen | | 11.933.010,90 |
| Rücknahmen | | (17.151.939,46) |
| Ausschüttung | | (17.082,90) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 33.366.723,82 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***41.676.380,95*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Europe Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Russland** | | | | |
| 700.000 | AEROFLOT PJSC | RUB | 579.556,35 | 1,39 |
| 298.000 | ALROSA PJSC | RUB | 469.922,89 | 1,13 |
| 954.500 | GAZPROM PJSC | RUB | 4.090.964,22 | 9,82 |
| 34.727 | LUKOIL PJSC | RUB | 2.853.771,63 | 6,85 |
| 9.000 | NOVATEK PJSC - GDR REG | USD | 2.050.908,15 | 4,92 |
| 410.000 | SBERBANK OF RUSSIA PJSC | RUB | 1.547.424,22 | 3,71 |
| 650.000 | SBERBANK OF RUSSIA PJSC | RUB | 2.626.070,24 | 6,30 |
| 180.000 | TATNEFT PJSC | RUB | 1.127.318,18 | 2,70 |
| 190.000 | TATNEFT PJSC - PREF 3 | RUB | 1.090.165,31 | 2,62 |
| 350.000.000 | VTB BANK PJSC | RUB | 214.947,86 | 0,51 |
| | | | **16.651.049,05** | **39,95** |
| **Griechenland** | | | | |
| 1.275.000 | ALPHA SERVICES AND HOLDINGS SA | EUR | 1.396.125,00 | 3,35 |
| 100.000 | ATHENS WATER SUPPLY & SEWAGE CO SA | EUR | 731.000,00 | 1,75 |
| 657.000 | EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS SA | EUR | 532.170,00 | 1,28 |
| 100.000 | MYTILINEOS SA | EUR | 1.410.000,00 | 3,38 |
| 70.000 | TERNA ENERGY SA | EUR | 803.600,00 | 1,93 |
| | | | **4.872.895,00** | **11,69** |
| **Niederlande** | | | | |
| 17.000 | RHI MAGNESITA NV | EUR | 654.500,00 | 1,57 |
| 2.100 | X5 RETAIL GROUP NV - GDR REG | RUB | 58.777,17 | 0,14 |
| 56.000 | X5 RETAIL GROUP NV - GDR REG | USD | 1.568.937,40 | 3,77 |
| 29.000 | YANDEX NV - A | USD | 1.994.054,96 | 4,78 |
| | | | **4.276.269,53** | **10,26** |
| **Luxemburg** | | | | |
| 71.000 | ALLEGRO.EU SA | PLN | 892.420,97 | 2,14 |
| 38.200 | BEFESA SA | EUR | 2.517.380,00 | 6,04 |
| 53.000 | INPOST SA | EUR | 757.370,00 | 1,82 |
| | | | **4.167.170,97** | **10,00** |
| **Türkei** | | | | |
| 120.000 | ARCELIK AS | TRY | 380.404,72 | 0,91 |
| 530.000 | AYDEM YENILENEBILIR ENERJI AS | TRY | 356.202,09 | 0,85 |
| 300.000 | ENERJISA ENERJI AS | TRY | 303.601,19 | 0,73 |
| 1 | ENKA INSAAT VE SANAYI AS | TRY | 1,01 | 0,00 |
| 1 | EREGLI DEMIR VE CELIK FABRIKALARI TAS | TRY | 1,62 | 0,00 |
| 1.300.000 | GALATA WIND ENERJI AS | TRY | 477.254,08 | 1,16 |
| 755.000 | HACI OMER SABANCI HOLDING AS | TRY | 717.867,25 | 1,72 |
| 120.000 | LOGO YAZILIM SANAYI VE TICARET AS | TRY | 485.295,72 | 1,16 |
| 500.000 | TURK TELEKOMUNIKASYON AS | TRY | 363.719,28 | 0,87 |
| 1.100.000 | TURKIYE SINAI KALKINMA BANKASI AS | TRY | 128.200,12 | 0,31 |
| | | | **3.212.547,08** | **7,71** |
| **Kasachstan** | | | | |
| 9.500 | HALYK SAVINGS BANK-GDR REG | USD | 139.350,27 | 0,33 |
| 95.500 | HALYK SAVINGS BANK-GDR REG | USD | 1.400.836,96 | 3,37 |
| 5.733 | KASPI.KZ JSC - GDR REG | USD | 525.341,56 | 1,26 |
| | | | **2.065.528,79** | **4,96** |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 1.225 | EPAM SYSTEMS INC | USD | 602.992,36 | 1,45 |
| 54.000 | GRID DYNAMICS HOLDINGS INC | USD | 1.361.473,75 | 3,26 |
| | | | **1.964.466,11** | **4,71** |
| **Österreich** | | | | |
| 27.000 | OMV AG | EUR | 1.408.860,00 | 3,38 |
| | | | **1.408.860,00** | **3,38** |
| **Polen** | | | | |
| 17.800 | MO-BRUK SA | PLN | 1.400.027,70 | 3,36 |
| | | | **1.400.027,70** | **3,36** |
| **Jersey** | | | | |
| 55.000 | POLYMETAL INTERNATIONAL PLC | GBP | 804.972,87 | 1,93 |
| | | | **804.972,87** | **1,93** |
| **Ungarn** | | | | |
| 18.000 | RICHTER GEDEON NYRT | HUF | 425.177,12 | 1,02 |
| | | | **425.177,12** | **1,02** |
| | | | **41.248.964,22** | **98,97** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **41.248.964,22** | **98,97** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **41.248.964,22** | **98,97** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **0,00** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **422.323,29** | **1,01** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **5.093,44** | **0,02** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **41.676.380,95** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 148.987.493,77 |
| | 30.09.2020 | USD | 116.544.763,89 |
| | 30.09.2019 | USD | 135.653.442,58 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 8.395,73 |
| | 30.09.2020 | USD | 7.967,30 |
| | 30.09.2019 | USD | 7.663,45 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.660,27 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.335,34 |
| | 30.09.2019 | EUR | 7.215,08 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 376,16 |
| | 30.09.2020 | EUR | 360,26 |
| | 30.09.2019 | EUR | 354,26 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 399,61 |
| | 30.09.2020 | USD | 381,57 |
| | 30.09.2019 | USD | 369,37 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 383,92 |
| | 30.09.2020 | USD | 367,72 |
| | 30.09.2019 | USD | 356,92 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 336,96 |
| | 30.09.2020 | EUR | 325,54 |
| | 30.09.2019 | EUR | 323,00 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | USD | 7.324,83 |
| | 30.09.2020 | USD | 6.901,30 |
| | 30.09.2019 | USD | 6.590,57 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 208 |
| | 30.09.2020 | | 125 |
| | 30.09.2019 | | 141 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 2.381 |
| | 30.09.2020 | | 2.031 |
| | 30.09.2019 | | 1.972 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 1.612 |
| | 30.09.2020 | | 1.887 |
| | 30.09.2019 | | 21.289 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 357 |
| | 30.09.2020 | | 467 |
| | 30.09.2019 | | 14.978 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | | 430 |
| | 30.09.2020 | | 285 |
| | 30.09.2019 | | 648 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 2.583 |
| | 30.09.2020 | 2.505 |
| | 30.09.2019 | 2.296 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | 16.940 |
| | 30.09.2020 | 13.916 |
| | 30.09.2019 | 15.820 |
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,92% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,50% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | 0,16% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 124,48% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **139.273.710,22** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 139.273.710,22 |
| **Bankguthaben** | | **6.923.970,60** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **608.630,35** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **9.514.781,28** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***156.321.092,45*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(6.507.938,55)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(825.660,13)** |
| Devisentermingeschäfte | | (498.033,31) |
| Futures | | (327.626,82) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(7.333.598,68)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***148.987.493,77*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **8.134.919,17** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 7.794.934,05 |
| Bankzinsen | | 728,27 |
| Sonstige Erträge | 10 | 339.256,85 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(447.176,89)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (185.081,62) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (219.907,00) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (4.856,34) |
| Abonnementsteuer | 9 | (15.971,13) |
| Bankzinsen | | (527,46) |
| Zinsen auf Swaps | | (20.833,34) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **7.687.742,28** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 3.291.969,50 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.927.330,89) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 780.238,58 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.375.181,28) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 36.851,84 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (26.996,61) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (1.274.427,69) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (478.422,03) |
| **Ergebnis** | | **6.714.443,70** |
| Zeichnungen | | 36.456.438,48 |
| Rücknahmen | | (10.728.152,30) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 116.544.763,89 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***148.987.493,77*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Anleihen und andere Schuldtitel

**Kaimaninseln**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 450.000 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC 2.625% 02/06/2026 | USD | 450.022,95 | 0,30 |
| 200.000 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC 3.750% 02/06/2031 | USD | 203.401,16 | 0,14 |
| 550.000 | ABQ FINANCE 3.125% 24/09/2024 EMTN | USD | 575.210,10 | 0,39 |
| 250.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 225.030,75 | 0,15 |
| 1.600.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 1.454.899,04 | 0,99 |
| 550.000 | ALDAR SUKUK NO 2 LTD 3.875% 22/10/2029 | USD | 599.559,43 | 0,40 |
| 500.000 | CDBL FUNDING 1 3.500% 24/10/2027 EMTN | USD | 528.205,41 | 0,35 |
| 300.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.250% 13/08/2024 | USD | 183.000,00 | 0,12 |
| 1.050.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.750% 24/05/2024 | USD | 645.076,06 | 0,43 |
| 200.000 | CHINA AOYUAN GROUP LTD 5.880% 01/03/2027 | USD | 153.362,50 | 0,10 |
| 200.000 | CHINA AOYUAN GROUP 7.950% 21/06/2024 | USD | 171.181,20 | 0,11 |
| 200.000 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.125% 22/07/2022 | USD | 203.034,52 | 0,14 |
| 200.000 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD 7.375% 02/05/2023 | USD | 204.920,06 | 0,14 |
| 700.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.000% 02/05/2025 | USD | 661.476,97 | 0,44 |
| 200.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.375% 09/04/2024 | USD | 193.340,26 | 0,13 |
| 1.300.000 | DP WORLD SALAAM FRN PERP | USD | 1.425.208,79 | 0,97 |
| 824.000 | EMAAR SUKUK LTD 3.875% 17/09/2029 EMTN | USD | 856.867,43 | 0,58 |
| 250.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 10.875% 09/01/2023 | USD | 80.083,61 | 0,05 |
| 200.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 11.875% 01/06/2023 | USD | 63.916,07 | 0,04 |
| 350.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP 10.875% 02/03/2024 | USD | 109.488,65 | 0,07 |
| 1.300.000 | GRAN TIERRA ENERGY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD 6.250% 15/02/2025 | USD | 1.130.704,02 | 0,76 |
| 258.000 | HILONG HOLDING LTD 9.750% 18/11/2024 | USD | 222.524,14 | 0,15 |
| 500.000 | INDUSTRIAL SENIOR TRUST 5.500% 01/11/2022 | USD | 515.844,76 | 0,35 |
| 350.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.650% 01/06/2026 | USD | 266.982,45 | 0,18 |
| 440.285 | ODEBRECHT OIL & GAS FINANCE LTD ZCP PERP | USD | 3.677,59 | 0,00 |
| 200.000 | RED SUN PROPERTIES GROUP LTD 7.300% 13/01/2025 | USD | 165.990,08 | 0,11 |
| 200.000 | RED SUN PROPERTIES GROUP LTD 9.500% 20/09/2023 | USD | 181.436,88 | 0,12 |
| 300.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 6.650% 03/08/2024 | USD | 241.703,63 | 0,16 |
| 471.000 | WEIBO CORP 1.250% 15/11/2022 | USD | 465.323,26 | 0,31 |
| 1.200.000 | WELL HOPE DEVELOPMENT LTD FRN PERP | USD | 1.225.147,72 | 0,82 |
| 400.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD FRN PERP | USD | 260.311,60 | 0,17 |
| 450.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.300% 27/05/2025 | USD | 330.683,12 | 0,22 |
| 300.000 | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 6.630% 07/01/2026 | USD | 254.930,82 | 0,17 |
| 450.000 | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.100% 10/09/2024 | USD | 395.711,30 | 0,27 |
| | | | **14.648.256,33** | **9,83** |

**Mexiko**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 770.000 | BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA/GRAND CAYMAN FRN PERP | USD | 815.411,20 | 0,55 |
| 1.200.000 | BBVA BANCOMER SA/TEXAS 18/01/2033 FRN | USD | 1.250.325,11 | 0,84 |
| 1.100.000 | BRASKEM IDESA SAPI 7.450% 15/11/2029 | USD | 1.166.203,59 | 0,78 |
| 1.335.000 | CIBANCO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE TRUST CIB/3332 4.375% 22/07/2031 | USD | 1.296.047,34 | 0,87 |
| 900.000 | GRUPO KUO SAB DE CV 5.750% 07/07/2027 | USD | 928.800,63 | 0,62 |
| 1.750.000 | MEXICO CITY AIRPORT TRUST 4.250% 31/10/2026 | USD | 1.866.520,62 | 1,26 |
| 1.600.000 | PETROLEOS MEXICANOS 5.950% 28/01/2031 | USD | 1.550.199,25 | 1,04 |
| 400.000 | PETROLEOS MEXICANOS 7.690% 23/01/2050 | USD | 378.384,28 | 0,25 |
| 1.235.000 | TRUST FIBRA UNO 6.390% 15/01/2050 | USD | 1.461.241,81 | 0,98 |
| | | | **10.713.133,83** | **7,19** |

**Jungferninseln**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 200.000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS FRN PERP | USD | 202.068,95 | 0,14 |
| 1.100.000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 1.102.749,26 | 0,74 |
| 800.000 | CAS CAPITAL NO 1 LTD FRN PERP | USD | 808.670,44 | 0,54 |
| 400.000 | CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HOLDING LTD FRN PERP | USD | 410.211,22 | 0,28 |
| 850.000 | CNRC CAPITALE LTD FRN PERP | USD | 860.651,30 | 0,58 |
| 525.000 | DIANJIAN INTERNATIONAL FINANCE LTD FRN PERP | USD | 543.371,81 | 0,36 |
| 300.000 | EASY TACTIC LTD 8.125% 27/02/2023 | USD | 218.077,73 | 0,15 |
| 800.000 | EASY TACTIC LTD 8.625% 27/02/2024 | USD | 527.882,95 | 0,35 |
| 400.000 | ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD FRN PERP | USD | 407.035,26 | 0,27 |
| 550.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 5.950% 19/10/2025 | USD | 560.861,96 | 0,38 |
| 1.700.000 | HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD FRN PERP | USD | 1.728.619,13 | 1,16 |
| 400.000 | HUARONG UNIVERSE INVESTMENT HOLDING LTD 1.625% 05/12/2022 | EUR | 379.468,27 | 0,25 |
| 450.000 | LEADER GOAL INTERNATIONAL LTD FRN PERP EMTN | USD | 462.378,46 | 0,31 |
| 1.000.000 | NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025 | USD | 922.846,59 | 0,62 |
| 550.000 | NWD FINANCE (BVI) LTD FRN PERP | USD | 544.076,26 | 0,37 |
| 500.000 | POWERCHINA ROADBRIDGE GROUP BRITISH VIRGIN ISLANDS LTD FRN PERP | USD | 503.023,07 | 0,34 |
| 443.350 | STAR ENERGY GEOTHERMAL WAYANG WINDU LTD 6.750% 24/04/2033 | USD | 509.111,36 | 0,34 |
| | | | **10.691.104,02** | **7,18** |

**Irland**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 750.000 | ALFA BANK AO VIA ALFA BOND ISSUANCE PLC FRN PERP | USD | 772.938,42 | 0,52 |
| 1.200.000 | ALFA BANK AO VIA ALFA BOND ISSUANCE PLC 26/10/2031 FRN | USD | 1.225.947,67 | 0,82 |
| 800.000 | BORETS FINANCE DAC 6.000% 17/09/2026 | USD | 832.979,78 | 0,56 |
| 1.980.000 | CREDIT BANK OF MOSCOW 3.875% 21/09/2026 | USD | 1.956.251,58 | 1,31 |
| 1.600.000 | C&W SENIOR FINANCING DAC 7.500% 15/10/2026 | USD | 1.661.559,57 | 1,12 |
| 1.143.000 | HACIENDA INVESTMENTS LTD VIA DME AIRPORT DAC 5.350% 08/02/2028 | USD | 1.204.401,50 | 0,81 |
| 1.900.000 | SOVCOMBANK VIA SOVCOM CAPITAL DAC 07/04/2030 FRN | USD | 2.047.660,29 | 1,37 |
| | | | **9.701.738,81** | **6,51** |

**Luxemburg**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 765.000 | AEGEA FINANCE SARL 5.750% 10/10/2024 | USD | 785.991,51 | 0,53 |
| 2.000.000 | FS LUXEMBOURG SARL 10.000% 15/12/2025 | USD | 2.190.400,00 | 1,47 |
| 1.510.000 | GOL FINANCE SA 8.000% 30/06/2026 EMTN | USD | 1.514.877,87 | 1,02 |
| 2.000.000 | MEXICO REMITTANCES FUNDING FIDUCIARY ESTATE MANAGEMENT SARL 4.875% 15/01/2028 | USD | 1.976.353,84 | 1,32 |
| 754.580 | MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA 4.500% 27/04/2031 | USD | 788.913,03 | 0,53 |
| 1.250.000 | RUMO LUXEMBOURG SARL 4.200% 18/01/2032 | USD | 1.227.035,73 | 0,82 |
| 1.000.000 | TUPY OVERSEAS SA 4.500% 16/02/2031 | USD | 978.955,34 | 0,66 |
| | | | **9.462.527,32** | **6,35** |

**Thailand**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 500.000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 520.876,56 | 0,35 |
| 650.000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 25/09/2034 FRN EMTN | USD | 661.843,41 | 0,44 |
| 700.000 | INDORAMA VENTURES GLOBAL SERVICES LTD 4.375% 12/09/2024 | USD | 711.581,59 | 0,48 |
| 350.000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 366.787,77 | 0,25 |
| 300.000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG 02/10/2031 FRN EMTN | USD | 302.886,23 | 0,20 |
| 850.000 | KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS FRN PERP | USD | 849.465,63 | 0,57 |
| 300.000 | MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP | USD | 305.518,07 | 0,21 |
| 1.350.000 | MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP | USD | 1.350.588,01 | 0,90 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 400.000 | THAIOIL TREASURY CENTER CO LTD 5.375% 20/11/2048 | USD | 451.468,86 | 0,30 |
| 1.000.000 | TMBTHANACHART BANK PCL FRN PERP EMTN | USD | 1.010.902,86 | 0,68 |
| | | | **6.531.918,99** | **4,38** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.550.000 | GAZPROM PJSC VIA GAZ FINANCE PLC FRN PERP | EUR | 1.861.512,76 | 1,25 |
| 1.935.258 | PETRA DIAMONDS US TREASURY PLC 10.500% 08/03/2026 | USD | 1.965.375,27 | 1,32 |
| 810.000 | TULLOW OIL PLC 10.250% 15/05/2026 | USD | 846.454,53 | 0,57 |
| 1.050.000 | TULLOW OIL PLC 7.000% 01/03/2025 | USD | 912.649,55 | 0,61 |
| 607.000 | UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 7.875% 15/07/2026 | USD | 615.121,77 | 0,41 |
| | | | **6.201.113,88** | **4,16** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 1.600.000 | AFRICA FINANCE CORP 4.375% 17/04/2026 EMTN | USD | 1.749.019,57 | 1,17 |
| 1.250.000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 4.125% 20/06/2024 EMTN | USD | 1.334.252,71 | 0,90 |
| 665.000 | ATP TOWER HOLDINGS LLC / ANDEAN TOWER PARTNERS COLOMBIA SAS / ANDEAN TELECOM PAR 4.050% 27/04/2026 | USD | 671.580,48 | 0,45 |
| 865.000 | BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 4.700% 22/10/2031 | USD | 950.200,91 | 0,64 |
| 900.000 | BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 3.500% 25/06/2024 | USD | 950.476,12 | 0,64 |
| | | | **5.655.529,79** | **3,80** |
| | **Hongkong** | | | |
| 300.000 | BANK OF EAST ASIA LTD/THE 29/05/2030 FRN EMTN | USD | 314.726,59 | 0,21 |
| 300.000 | CHONG HING BANK LTD 26/07/2027 FRN | USD | 301.748,12 | 0,20 |
| 800.000 | CMB WING LUNG BANK LTD 22/11/2027 FRN EMTN | USD | 815.929,42 | 0,55 |
| 1.250.000 | FAR EAST HORIZON LTD FRN PERP EMTN | USD | 1.253.264,10 | 0,84 |
| 750.000 | SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 17/01/2029 FRN | USD | 797.227,60 | 0,54 |
| 1.700.000 | WEICHAI INTERNATIONAL HONG KONG ENERGY GROUP CO LTD FRN PERP | USD | 1.731.124,43 | 1,16 |
| 400.000 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD 7.500% 17/02/2025 | USD | 260.017,20 | 0,17 |
| | | | **5.474.037,46** | **3,67** |
| | **Brasilien** | | | |
| 1.500.000 | BANCO BTG PACTUAL SA/CAYMAN ISLANDS 2.750% 11/01/2026 | USD | 1.459.430,94 | 0,97 |
| 1.150.000 | BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL SA 28/01/2031 FRN | USD | 1.154.930,29 | 0,78 |
| 1.015.000 | BRF SA 4.875% 24/01/2030 | USD | 1.017.967,75 | 0,68 |
| 600.000 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA/CAYMAN ISLAND 21/11/2029 FRN | USD | 605.347,64 | 0,41 |
| 1.100.000 | OI MOVEL SA 8.750% 30/07/2026 | USD | 1.124.922,21 | 0,76 |
| | | | **5.362.598,83** | **3,60** |
| | **Südkorea** | | | |
| 1.650.000 | HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 1.719.805,41 | 1,15 |
| 1.300.000 | HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 1.319.492,71 | 0,89 |
| 1.050.000 | KYOBO LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 1.069.324,52 | 0,72 |
| 900.000 | TONGYANG LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 951.348,95 | 0,64 |
| | | | **5.059.971,59** | **3,40** |
| | **Niederlande** | | | |
| 197.000 | GREENKO DUTCH BV 3.850% 29/03/2026 | USD | 200.282,92 | 0,13 |
| 565.000 | METINVEST BV 7.650% 01/10/2027 | USD | 613.086,14 | 0,41 |
| 900.000 | METINVEST BV 7.750% 17/10/2029 | USD | 972.119,73 | 0,65 |
| 1.700.000 | MINEJESA CAPITAL BV 5.625% 10/08/2037 | USD | 1.806.594,32 | 1,22 |
| 1.094.000 | VIVO ENERGY INVESTMENTS BV 5.125% 24/09/2027 | USD | 1.157.224,54 | 0,78 |
| | | | **4.749.307,65** | **3,19** |
| | **Kanada** | | | |
| 1.100.000 | CANACOL ENERGY LTD 7.250% 03/05/2025 | USD | 1.155.595,64 | 0,78 |
| 1.650.000 | FIRST QUANTUM MINERALS LTD 7.500% 01/04/2025 | USD | 1.695.986,24 | 1,13 |
| 1.300.000 | FRONTERA ENERGY CORP 7.875% 21/06/2028 | USD | 1.263.120,14 | 0,85 |
| | | | **4.114.702,02** | **2,76** |
| | **Türkei** | | | |
| 600.000 | AKBANK TAS 5.000% 24/10/2022 | USD | 614.828,38 | 0,41 |
| 600.000 | AKBANK TAS 5.125% 31/03/2025 EMTN | USD | 600.017,00 | 0,40 |
| 1.115.000 | AYDEM YENILENEBILIR ENERJI AS 7.750% 02/02/2027 | USD | 1.088.267,64 | 0,74 |
| 1.020.000 | PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS 9.250% 30/04/2026 | USD | 1.076.785,71 | 0,72 |
| 500.000 | TURKIYE GARANTI BANKASI AS 5.250% 13/09/2022 | USD | 512.286,14 | 0,34 |
| | | | **3.892.184,87** | **2,61** |
| | **Vereinigte Arabische Emirate** | | | |
| 800.000 | EMIRATES NBD BANK PJSC FRN PERP | USD | 874.228,16 | 0,59 |
| 1.050.000 | EMIRATES NBD BANK PJSC FRN PERP | USD | 1.115.303,57 | 0,75 |
| 1.065.000 | NBK TIER 1 FINANCING LTD FRN PERP | USD | 1.064.680,55 | 0,71 |
| | | | **3.054.212,28** | **2,05** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 1.626.000 | KOSMOS ENERGY LTD 7.125% 04/04/2026 | USD | 1.590.296,19 | 1,07 |
| 500.000 | NBM US HOLDINGS INC 6.625% 06/08/2029 | USD | 550.549,70 | 0,37 |
| 200.000 | PERIAMA HOLDINGS LLC/DE 5.950% 19/04/2026 | USD | 214.528,70 | 0,14 |
| 500.000 | RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 16/04/2029 | USD | 508.587,62 | 0,34 |
| | | | **2.863.962,21** | **1,92** |
| | **Jersey** | | | |
| 998.000 | GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.160% 31/03/2034 | USD | 981.608,36 | 0,66 |
| 1.200.000 | GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.625% 31/03/2036 | USD | 1.183.374,47 | 0,80 |
| 600.000 | WEST CHINA CEMENT LTD 4.950% 08/07/2026 | USD | 584.463,52 | 0,39 |
| | | | **2.749.446,35** | **1,85** |
| | **Dominikanische Republik** | | | |
| 2.275.000 | AEROPUERTOS DOMINICANOS SIGLO XXI SA 6.750% 30/03/2029 | USD | 2.372.565,04 | 1,59 |
| | | | **2.372.565,04** | **1,59** |
| | **Mauritius** | | | |
| 450.000 | GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 16/08/2023 | USD | 452.372,00 | 0,30 |
| 995.000 | HTA GROUP LTD 7.000% 18/12/2025 | USD | 1.045.760,70 | 0,71 |
| 500.000 | UPL CORP LTD FRN PERP | USD | 509.956,03 | 0,34 |
| 200.000 | UPL CORP LTD 4.625% 16/06/2030 | USD | 212.423,38 | 0,14 |
| | | | **2.220.512,11** | **1,49** |
| | **Georgien** | | | |
| 746.000 | SILKNET JSC 11.000% 02/04/2024 | USD | 808.306,32 | 0,54 |
| 1.300.000 | TBC BANK JSC 5.750% 19/06/2024 EMTN | USD | 1.390.677,83 | 0,94 |
| | | | **2.198.984,15** | **1,48** |
| | **Argentinien** | | | |
| 700.000 | TELECOM ARGENTINA SA 8.000% 18/07/2026 | USD | 650.703,61 | 0,44 |
| 650.000 | TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SA 6.750% 02/05/2025 | USD | 607.297,24 | 0,41 |
| 900.000 | YPF SA 8.500% 28/07/2025 | USD | 749.949,52 | 0,50 |
| | | | **2.007.950,37** | **1,35** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Insel Man** | | | |
| 700.000 | ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 6.500% 15/04/2040 | USD | 858.581,71 | 0,58 |
| 800.000 | GOHL CAPITAL LTD 4.250% 24/01/2027 | USD | 841.973,05 | 0,56 |
| | | | **1.700.554,76** | **1,14** |
| | **Philippinen** | | | |
| 500.000 | GLOBE TELECOM INC 3.000% 23/07/2035 | USD | 464.132,02 | 0,31 |
| 1.050.000 | SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP | USD | 1.098.608,22 | 0,74 |
| | | | **1.562.740,24** | **1,05** |
| | **Bermuda** | | | |
| 1.500.000 | SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 1.538.150,21 | 1,03 |
| | | | **1.538.150,21** | **1,03** |
| | **Singapur** | | | |
| 400.000 | GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025 | USD | 412.725,47 | 0,28 |
| 485.000 | LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.250% 19/06/2024 | USD | 504.506,77 | 0,34 |
| 300.000 | LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.500% 09/02/2026 | USD | 310.539,77 | 0,21 |
| 600.000 | MODERNLAND OVERSEAS PTE LTD 6.950% 13/04/2024 | USD | 276.827,28 | 0,18 |
| | | | **1.504.599,29** | **1,01** |
| | **China** | | | |
| 1.150.000 | CHINA MINMETALS CORP FRN PERP | USD | 1.173.895,03 | 0,78 |
| 300.000 | WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD 2.349% 29/10/2025 | USD | 276.688,59 | 0,19 |
| | | | **1.450.583,62** | **0,97** |
| | **Indien** | | | |
| 550.000 | ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% 08/09/2024 | USD | 551.151,48 | 0,37 |
| 500.000 | JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 18/05/2031 | USD | 497.930,02 | 0,33 |
| 300.000 | JSW STEEL LTD 5.050% 05/04/2032 | USD | 298.615,19 | 0,20 |
| | | | **1.347.696,69** | **0,90** |
| | **Israel** | | | |
| 1.150.000 | ENERGEAN ISRAEL FINANCE LTD 4.500% 30/03/2024 | USD | 1.173.519,24 | 0,79 |
| | | | **1.173.519,24** | **0,79** |
| | **Nigeria** | | | |
| 1.100.000 | SEPLAT ENERGY PLC 7.750% 01/04/2026 | USD | 1.145.209,63 | 0,77 |
| | | | **1.145.209,63** | **0,77** |
| | **Peru** | | | |
| 1.074.412 | FENIX POWER PERU SA 4.317% 20/09/2027 | USD | 1.097.883,02 | 0,74 |
| | | | **1.097.883,02** | **0,74** |
| | **Oman** | | | |
| 978.000 | OMAN ARAB BANK SAOC FRN PERP | USD | 1.022.537,35 | 0,69 |
| | | | **1.022.537,35** | **0,69** |
| | **Panama** | | | |
| 920.000 | BANCO GENERAL SA 4.125% 07/08/2027 | USD | 990.057,42 | 0,66 |
| | | | **990.057,42** | **0,66** |
| | **Kuwait** | | | |
| 850.000 | AL AHLI BANK OF KUWAIT KSCP FRN PERP | USD | 903.114,80 | 0,61 |
| | | | **903.114,80** | **0,61** |
| | **Spanien** | | | |
| 794.000 | AI CANDELARIA SPAIN SLU 7.500% 15/12/2028 | USD | 865.103,73 | 0,58 |
| | | | **865.103,73** | **0,58** |
| | **Trinidad und Tobago** | | | |
| 750.000 | TELECOMMUNICATIONS SERVICES OF TRINIDAD & TOBAGO LTD 8.875% 18/10/2029 | USD | 802.886,04 | 0,54 |
| | | | **802.886,04** | **0,54** |
| | **Indonesien** | | | |
| 500.000 | ALAM SUTERA REALTY TBK 6.250% 02/11/2025 | USD | 397.355,79 | 0,27 |
| 350.000 | BANK NEGARA INDONESIA 3.750% 30/03/2026 EMTN | USD | 359.828,33 | 0,24 |
| | | | **757.184,12** | **0,51** |
| | **Bahamas** | | | |
| 610.000 | INTERCORP PERU LTD 3.875% 15/08/2029 | USD | 598.187,91 | 0,40 |
| | | | **598.187,91** | **0,40** |
| | **Chile** | | | |
| 325.000 | AES ANDES SA 07/10/2079 FRN | USD | 343.932,95 | 0,23 |
| 200.000 | AES ANDES SA 26/03/2079 FRN | USD | 212.024,87 | 0,14 |
| | | | **555.957,82** | **0,37** |
| | **Paraguay** | | | |
| 535.000 | BANCO CONTINENTAL SAECA 2.750% 10/12/2025 | USD | 531.986,43 | 0,36 |
| | | | **531.986,43** | **0,36** |
| | | | **139.273.710,22** | **93,48** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **139.273.710,22** | **93,48** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | **Devisentermingeschäfte** | | | |
| 2.437.734,86 | USD | 2.063.290,35 | EUR | 29/10/2021 | 2.437.734,86 | 45.320,00 |
| 36.771,58 | USD | 31.312,77 | EUR | 19/10/2021 | 36.771,58 | 470,91 |
| 439,64 | USD | 376,61 | EUR | 01/10/2021 | 439,64 | 3,17 |
| 260,77 | EUR | 304,41 | USD | 01/10/2021 | 304,41 | (2,19) |
| 40.000,00 | EUR | 46.925,25 | USD | 29/10/2021 | 46.925,25 | (544,67) |
| 19.955.797,58 | EUR | 23.677.888,98 | USD | 19/10/2021 | 23.677.888,98 | (543.280,53) |
| | | | | | **26.200.064,72** | **(498.033,31)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Corporate Debt

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| (10) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 1.563.771,21 | 12.053,08 |
| 28 | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 4.458.125,00 | (132.545,67) |
| 20 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 3.821.250,00 | (157.467,50) |
| 20 | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 2.632.187,50 | (39.643,28) |
| 7 | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 1.016.750,00 | (22.148,44) |
| (16) | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 1.963.875,01 | 12.124,99 |
| | | | **15.455.958,72** | **(327.626,82)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(825.660,13)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **139.273.710,22** | **93,48** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(825.660,13)** | **(0,55)** |
| **Bankguthaben** | **6.923.970,60** | **4,65** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **3.615.473,08** | **2,42** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **148.987.493,77** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 7.033.973.351,64 |
| | 30.09.2020 | USD | 6.335.652.684,61 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.945.170.441,93 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 8.990,21 |
| | 30.09.2020 | USD | 8.541,66 |
| | 30.09.2019 | USD | 8.387,20 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 6.125,26 |
| | 30.09.2020 | CHF | 5.894,85 |
| | 30.09.2019 | CHF | 5.950,01 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.966,83 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.730,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.768,92 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | - |
| | 30.09.2020 | GBP | - |
| | 30.09.2019 | GBP | 105,45 |
| Capitalisation N (USD) | 30.09.2021 | USD | 426,27 |
| | 30.09.2020 | USD | 405,07 |
| | 30.09.2019 | USD | 397,82 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.633,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.408,33 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.444,13 |
| Capitalisation O Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.519,91 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.286,83 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.311,33 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 406,54 |
| | 30.09.2020 | USD | 388,63 |
| | 30.09.2019 | USD | 383,97 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 281,35 |
| | 30.09.2020 | CHF | 272,23 |
| | 30.09.2019 | CHF | 276,53 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 6.691,03 |
| | 30.09.2020 | CZK | 6.433,82 |
| | 30.09.2019 | CZK | 6.492,87 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.356,46 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.172,92 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.237,93 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 413,64 |
| | 30.09.2020 | USD | 393,55 |
| | 30.09.2019 | USD | 386,95 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 113.464,72 |
| | 30.09.2020 | HUF | 108.711,38 |
| | 30.09.2019 | HUF | 106.875,89 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 385,85 |
| | 30.09.2020 | USD | 369,97 |
| | 30.09.2019 | USD | 366,61 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.068,74 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.909,09 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.988,70 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 338,06 |
| | 30.09.2020 | USD | 327,41 |
| | 30.09.2019 | USD | 327,72 |
| Capitalisation Y Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 294,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 288,27 |
| | 30.09.2019 | EUR | 295,87 |
| Capitalisation Z Hedged (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.115,64 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.110,16 |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.718,57 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.443,74 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.430,04 |
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.936,51 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.940,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | 3.099,00 |
| Distribution I (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.060,65 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.008,41 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.193,99 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 19.032,60 |
| | 30.09.2020 | PLN | 18.944,62 |
| | 30.09.2019 | PLN | 19.856,79 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 94,32 |
| | 30.09.2020 | GBP | 93,69 |
| | 30.09.2019 | GBP | 97,96 |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 947,79 |
| | 30.09.2020 | EUR | 949,24 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.000,10 |
| Distribution N (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.552,03 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.524,76 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.596,36 |
| Distribution O Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 947,90 |
| | 30.09.2020 | EUR | 949,29 |
| | 30.09.2019 | EUR | 999,72 |
| Distribution O (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.566,82 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.539,50 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.611,10 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 943,24 |
| | 30.09.2020 | EUR | 944,65 |
| | 30.09.2019 | EUR | 994,85 |
| Distribution P (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.529,69 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.502,76 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.573,99 |
| Distribution R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.033,85 |
| Distribution R (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.556,87 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.530,28 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.601,61 |
| Distribution X (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.091,30 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.081,90 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.111,52 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 77,43 |
| | 30.09.2020 | USD | 82,13 |
| | 30.09.2019 | USD | 89,94 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 171,95 |
| | 30.09.2020 | AUD | 183,16 |
| | 30.09.2019 | AUD | 204,44 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 217,33 |
| | 30.09.2020 | EUR | 217,57 |
| | 30.09.2019 | EUR | 230,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 1.982,83 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 2.197,23 |
| | 30.09.2019 | ZAR | 2.552,60 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 166,52 |
| | 30.09.2020 | USD | 178,41 |
| | 30.09.2019 | USD | 197,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 150,86 |
| | 30.09.2020 | AUD | 162,57 |
| | 30.09.2019 | AUD | 183,45 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 1.840,08 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 2.060,77 |
| | 30.09.2019 | ZAR | 2.423,82 |
| Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.777,63 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.738,89 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.956,80 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 14.679 |
| | 30.09.2020 | 21.346 |
| | 30.09.2019 | 229.649 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 64 |
| | 30.09.2020 | 38 |
| | 30.09.2019 | 50 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 54.870 |
| | 30.09.2020 | 57.650 |
| | 30.09.2019 | 86.431 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 365 |
| Capitalisation N (USD) | 30.09.2021 | 5.186 |
| | 30.09.2020 | 5.965 |
| | 30.09.2019 | 7.522 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1.407 |
| | 30.09.2020 | 1.428 |
| | 30.09.2019 | 2.641 |
| Capitalisation O Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 96 |
| | 30.09.2020 | 162 |
| | 30.09.2019 | 1.244 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 32.132 |
| | 30.09.2020 | 59.466 |
| | 30.09.2019 | 57.921 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 981 |
| | 30.09.2020 | 1.281 |
| | 30.09.2019 | 1.356 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 8.762 |
| | 30.09.2020 | 5.200 |
| | 30.09.2019 | 13 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 9.017 |
| | 30.09.2020 | 10.543 |
| | 30.09.2019 | 20.469 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1.998 |
| | 30.09.2020 | 1.074 |
| | 30.09.2019 | 5.972 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 2.239 |
| | 30.09.2020 | 2.549 |
| | 30.09.2019 | 2.813 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 93.901 |
| | 30.09.2020 | 185.281 |
| | 30.09.2019 | 109.458 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 5.295 |
| | 30.09.2020 | 6.365 |
| | 30.09.2019 | 6.545 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | | |
|---|---|---|
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 126.346 |
| | 30.09.2020 | 201.778 |
| | 30.09.2019 | 158.126 |
| Capitalisation Y Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 16.077 |
| | 30.09.2020 | 29.552 |
| | 30.09.2019 | 23.178 |
| Capitalisation Z Hedged (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 1.267 |
| | 30.09.2019 | 1.267 |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 27.289 |
| | 30.09.2020 | 15.538 |
| | 30.09.2019 | 13.320 |
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 52.639 |
| | 30.09.2020 | 55.177 |
| | 30.09.2019 | 144.949 |
| Distribution I (M) (USD) | 30.09.2021 | 824 |
| | 30.09.2020 | 928 |
| | 30.09.2019 | 3.142 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 12.299 |
| | 30.09.2020 | 7.185 |
| | 30.09.2019 | 4.610 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 1.208 |
| | 30.09.2020 | 362 |
| | 30.09.2019 | 1.512 |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 33.194 |
| | 30.09.2020 | 25.311 |
| | 30.09.2019 | 27.940 |
| Distribution N (Q) (USD) | 30.09.2021 | 715 |
| | 30.09.2020 | 742 |
| | 30.09.2019 | 593 |
| Distribution O Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 2.932 |
| | 30.09.2020 | 3.847 |
| | 30.09.2019 | 39.307 |
| Distribution O (Q) (USD) | 30.09.2021 | 139 |
| | 30.09.2020 | 139 |
| | 30.09.2019 | 1.699 |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 25.787 |
| | 30.09.2020 | 34.175 |
| | 30.09.2019 | 40.527 |
| Distribution P (Q) (USD) | 30.09.2021 | 3.127 |
| | 30.09.2020 | 5.820 |
| | 30.09.2019 | 8.622 |

| Anzahl der Anteile | | |
|---|---|---|
| Distribution R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 23 |
| Distribution R (Q) (USD) | 30.09.2021 | 32 |
| | 30.09.2020 | 208 |
| | 30.09.2019 | 128 |
| Distribution X (USD) | 30.09.2021 | 6.593 |
| | 30.09.2020 | 7.597 |
| | 30.09.2019 | 11.053 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 16.225.500 |
| | 30.09.2020 | 13.060.242 |
| | 30.09.2019 | 4.893.427 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1.622.193 |
| | 30.09.2020 | 1.730.004 |
| | 30.09.2019 | 1.017.818 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 19.287 |
| | 30.09.2020 | 30.263 |
| | 30.09.2019 | 37.100 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 9.130.257 |
| | 30.09.2020 | 4.680.625 |
| | 30.09.2019 | 1.228.949 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 4.353.499 |
| | 30.09.2020 | 5.279.109 |
| | 30.09.2019 | 3.037.211 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 845.784 |
| | 30.09.2020 | 1.155.673 |
| | 30.09.2019 | 1.285.467 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 3.552.254 |
| | 30.09.2020 | 3.437.216 |
| | 30.09.2019 | 1.519.599 |
| Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 342.210 |
| | 30.09.2020 | 291.921 |
| | 30.09.2019 | 110.704 |

| Dividende | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 128,20 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 15,86 |
| Distribution I (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 15,86 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 15,86 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 15,94 |
| Distribution I (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 15,94 |
| Distribution I (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 15,94 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 17,55 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 17,55 |
| Distribution I (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 17,55 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 20,43 |
| Distribution I (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 20,43 |
| Distribution I (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 20,43 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 02.09.2021 | PLN | 64,75 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 03.08.2021 | PLN | 64,75 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 02.07.2021 | PLN | 64,75 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 02.06.2021 | PLN | 65,62 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 04.05.2021 | PLN | 65,62 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 07.04.2021 | PLN | 65,62 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 02.03.2021 | PLN | 67,14 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 02.02.2021 | PLN | 67,14 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 05.01.2021 | PLN | 67,14 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 02.12.2020 | PLN | 70,41 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 03.11.2020 | PLN | 70,41 |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 02.10.2020 | PLN | 70,41 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 11.08.2021 | GBP | 0,90 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 12.05.2021 | GBP | 0,95 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 11.02.2021 | GBP | 1,05 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 11.11.2020 | GBP | 1,00 |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 41,20 |
| Distribution N (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 24,85 |
| Distribution N (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 25,45 |
| Distribution N (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 27,80 |
| Distribution N (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 26,65 |
| Distribution O Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 43,70 |
| Distribution O (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 26,55 |
| Distribution O (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 27,10 |
| Distribution O (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 29,65 |
| Distribution O (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 28,45 |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 35,35 |
| Distribution P (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 20,75 |
| Distribution P (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 21,50 |
| Distribution P (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 23,65 |
| Distribution P (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 22,65 |
| Distribution R (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 24,80 |
| Distribution R (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 27,15 |
| Distribution R (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 26,00 |
| Distribution X (USD) | 14.12.2020 | USD | 37,50 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,70 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,70 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,70 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 1,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 1,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 1,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 1,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 1,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 1,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 1,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 1,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 1,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 1,59 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 1,59 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 1,59 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 02.09.2021 | EUR | 0,58 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 03.08.2021 | EUR | 0,58 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 02.07.2021 | EUR | 0,58 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 02.06.2021 | EUR | 0,59 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 04.05.2021 | EUR | 0,59 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 07.04.2021 | EUR | 0,59 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 02.03.2021 | EUR | 0,61 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 02.02.2021 | EUR | 0,61 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 05.01.2021 | EUR | 0,61 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 02.12.2020 | EUR | 0,64 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 03.11.2020 | EUR | 0,64 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 02.10.2020 | EUR | 0,64 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 31,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 31,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 31,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 31,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 31,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 31,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 31,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 31,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 31,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 36,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 36,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 36,50 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,55 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,55 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,55 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 1,33 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 1,33 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 1,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 1,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 1,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 29,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 29,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 29,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 29,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 29,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 29,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 29,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 29,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 29,60 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 35,00 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 35,00 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 35,00 |
| Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR) | 11.08.2021 | EUR | 46,45 |
| Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR) | 12.05.2021 | EUR | 47,60 |
| Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR) | 11.02.2021 | EUR | 52,10 |
| Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR) | 11.11.2020 | EUR | 49,95 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,89% |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Capitalisation N (USD) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,93% |
| Capitalisation O Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,50% |
| Capitalisation P Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 1,53% |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 1,53% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,53% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,03% |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 1,81% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,81% |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 2,81% |
| Capitalisation Y Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 2,82% |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,02% |
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Distribution I (M) (USD) | 30.09.2021 | 0,89% |
| Distribution I (M) Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,93% |
| Distribution N (Q) (USD) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Distribution O Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Distribution O (Q) (USD) | 30.09.2021 | 0,67% |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,53% |
| Distribution P (Q) (USD) | 30.09.2021 | 1,50% |
| Distribution R (Q) (USD) | 30.09.2021 | 1,02% |
| Distribution X (USD) | 30.09.2021 | 1,81% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 1,81% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,81% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 2,83% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 2,83% |
| Distribution Z (Q) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,11% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (38,68%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **6.513.680.257,04** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 441.962.099,83 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 6.071.718.157,21 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **54.823.866,53** |
| Credit Default Swaps | | 41.933.061,65 |
| Futures | | 12.890.804,88 |
| **Bankguthaben** | | **343.701.510,74** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **18.518.177,82** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **648.691.860,10** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***7.579.415.672,23*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(1.028.546,60)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(413.807.995,95)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(130.605.778,04)** |
| Devisentermingeschäfte | | (130.605.778,04) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(545.442.320,59)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***7.033.973.351,64*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **368.185.162,73** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 364.289.269,90 |
| Bankzinsen | | 286.173,69 |
| Zinsen auf Swaps | | 55.714,84 |
| Sonstige Erträge | 10 | 3.554.004,30 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(108.862.214,15)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (67.887.741,92) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (29.367.404,28) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (931.118,02) |
| Abonnementsteuer | 9 | (2.310.765,80) |
| Bankzinsen | | (111.751,48) |
| Zinsen auf Swaps | | (8.253.432,65) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **259.322.948,58** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 135.512.084,11 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (56.087.060,61) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 327.849.353,86 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (114.980.995,01) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 27.880.784,80 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (25.185.613,43) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (101.129.631,64) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (46.454.700,71) |
| **Ergebnis** | | **406.727.169,95** |
| Zeichnungen | | 5.104.664.090,10 |
| Rücknahmen | | (4.197.448.208,70) |
| Ausschüttung | | (615.622.384,32) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 6.335.652.684,61 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***7.033.973.351,64*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Mexiko** | | | |
| 10.725.000 | CIBANCO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE TRUST CIB/3332 4.375% 22/07/2031 | USD | 10.412.065,74 | 0,15 |
| 9.000.000 | COMISION FEDERAL DE ELECTRICIDAD 4.677% 09/02/2051 | USD | 8.688.552,66 | 0,12 |
| 1.150.000 | ELECTRICIDAD FIRME DE MEXICO HOLDINGS SA DE CV 4.900% 20/11/2026 | USD | 1.148.562,44 | 0,02 |
| 6.000.000 | MEXICO CITY AIRPORT TRUST 5.500% 31/07/2047 | USD | 6.123.043,56 | 0,09 |
| 17.500.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.659% 24/05/2031 | USD | 16.875.957,00 | 0,24 |
| 21.160.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 19/04/2071 | USD | 18.337.610,43 | 0,26 |
| 19.400.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.771% 24/05/2061 | USD | 17.226.633,71 | 0,24 |
| 1.300.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 31/01/2050 | USD | 1.331.918,43 | 0,02 |
| 9.000.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.600% 10/02/2048 | USD | 9.309.500,55 | 0,13 |
| 5.260.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 27/04/2051 | USD | 5.781.293,04 | 0,08 |
| 2.000.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 19/03/2114 EMTN | GBP | 2.953.332,00 | 0,04 |
| 12.800.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 12/10/2110 GMTN | USD | 14.583.028,61 | 0,21 |
| 4.500.000 | PETROLEOS MEXICANOS 5.500% 27/06/2044 | USD | 3.605.411,93 | 0,05 |
| 6.000.000 | PETROLEOS MEXICANOS 5.625% 23/01/2046 | USD | 4.824.841,08 | 0,07 |
| 14.300.000 | PETROLEOS MEXICANOS 5.950% 28/01/2031 | USD | 13.854.905,78 | 0,20 |
| 55.000.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.350% 12/02/2048 | USD | 46.281.833,95 | 0,66 |
| 12.900.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.375% 23/01/2045 | USD | 10.949.494,20 | 0,16 |
| 6.600.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.500% 02/06/2041 | USD | 5.852.169,97 | 0,08 |
| 4.238.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.625% PERP | USD | 3.555.908,48 | 0,05 |
| 43.478.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.750% 21/09/2047 | USD | 37.945.169,72 | 0,54 |
| 18.000.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.875% 16/10/2025 | USD | 19.726.116,12 | 0,28 |
| 21.785.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.950% 28/01/2060 | USD | 19.032.918,16 | 0,27 |
| 41.000.000 | PETROLEOS MEXICANOS 7.690% 23/01/2050 | USD | 38.784.388,70 | 0,55 |
| | | | **317.184.656,26** | **4,51** |
| | **Ägypten** | | | |
| 12.726.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 16/02/2026 | USD | 11.965.351,71 | 0,17 |
| 8.760.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 06/10/2025 | USD | 8.926.609,86 | 0,13 |
| 850.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 16/04/2030 EMTN | EUR | 940.568,79 | 0,01 |
| 1.185.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 29/05/2024 | USD | 1.235.013,42 | 0,02 |
| 30.825.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.800% 30/09/2027 EMTN | USD | 30.259.152,26 | 0,43 |
| 3.318.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 16/02/2031 EMTN | USD | 3.046.555,51 | 0,04 |
| 9.378.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 31/01/2022 | USD | 9.444.073,17 | 0,13 |
| 15.190.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 11/04/2031 EMTN | EUR | 17.257.575,82 | 0,25 |
| 7.500.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.052% 15/01/2032 EMTN | USD | 7.261.956,30 | 0,10 |
| 38.507.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 16/02/2061 | USD | 33.807.930,72 | 0,48 |
| 1.850.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 31/01/2027 | USD | 1.959.747,44 | 0,03 |
| 22.885.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 29/05/2032 | USD | 22.794.625,53 | 0,32 |
| 4.300.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.903% 21/02/2048 | USD | 3.921.307,64 | 0,06 |
| 7.270.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.150% 20/11/2059 EMTN | USD | 6.700.673,72 | 0,10 |
| 13.855.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.500% 31/01/2047 | USD | 13.385.303,03 | 0,19 |
| 41.095.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.700% 01/03/2049 | USD | 39.859.442,25 | 0,57 |
| 22.130.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 30/09/2051 EMTN | USD | 21.643.804,12 | 0,31 |
| 27.275.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 29/05/2050 | USD | 26.992.522,92 | 0,38 |
| | | | **261.402.214,21** | **3,72** |
| | **Türkei** | | | |
| 21.000.000 | ISTANBUL METROPOLITAN MUNICIPALITY 6.375% 09/12/2025 | USD | 20.702.802,33 | 0,29 |
| 8.185.000 | PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS 9.250% 30/04/2026 | USD | 8.640.677,45 | 0,12 |
| 25.975.000 | TURK IHRACAT KREDI BANKASI AS 5.750% 06/07/2026 | USD | 25.549.687,95 | 0,36 |
| 4.375.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.375% 08/07/2027 | EUR | 5.031.569,24 | 0,07 |
| 12.031.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 26/01/2026 | USD | 11.622.188,42 | 0,17 |
| 10.676.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 09/10/2026 | USD | 10.236.584,49 | 0,15 |
| 3.400.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 16/04/2043 | USD | 2.637.889,05 | 0,04 |
| 17.890.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 13/03/2030 | USD | 16.509.497,40 | 0,23 |
| 3.820.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.600% 14/11/2024 | USD | 3.866.105,53 | 0,05 |
| 22.450.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 11/05/2047 | USD | 18.564.859,35 | 0,26 |
| 14.950.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 26/06/2031 | USD | 14.048.426,05 | 0,20 |
| 9.230.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.950% 15/01/2031 | USD | 8.724.316,82 | 0,12 |
| 13.090.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.350% 10/08/2024 | USD | 13.547.160,40 | 0,19 |
| 21.110.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 14/10/2025 | USD | 21.657.935,17 | 0,31 |
| 9.965.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 20/09/2033 | USD | 9.572.131,67 | 0,14 |
| 28.050.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 17/02/2045 | USD | 25.703.006,01 | 0,37 |
| 7.845.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 26/04/2029 | USD | 8.361.813,07 | 0,12 |
| 3.010.000 | TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS 8.250% 24/01/2024 | USD | 3.237.148,84 | 0,05 |
| | | | **228.213.799,24** | **3,24** |
| | **Indonesien** | | | |
| 3.200.000 | HUTAMA KARYA PERSERO PT 3.750% 11/05/2030 EMTN | USD | 3.466.568,03 | 0,05 |
| 4.050.000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 4.750% 15/05/2025 | USD | 4.414.710,96 | 0,06 |
| 15.850.000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 5.450% 15/05/2030 | USD | 18.250.654,47 | 0,26 |
| 6.650.000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 5.800% 15/05/2050 | USD | 7.777.739,05 | 0,11 |
| 8.000.000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 6.530% 15/11/2028 | USD | 9.730.903,92 | 0,14 |
| 8.980.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.400% 30/10/2031 | EUR | 10.542.482,22 | 0,15 |
| 2.000.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.850% 14/02/2030 | USD | 2.070.898,86 | 0,03 |
| 2.650.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.700% 30/10/2049 | USD | 2.689.351,68 | 0,04 |
| 5.240.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.850% 15/10/2030 | USD | 5.858.653,00 | 0,08 |
| 4.605.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.200% 15/10/2050 | USD | 5.101.612,32 | 0,07 |
| 3.450.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.350% 11/01/2048 | USD | 3.841.974,65 | 0,05 |
| 15.667.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 17/01/2042 EMTN | USD | 19.090.864,77 | 0,27 |
| 4.025.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 24/04/2032 | USD | 4.591.320,60 | 0,07 |
| 13.017.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 17/02/2037 | USD | 17.762.082,84 | 0,25 |
| 27.300.000 | PERTAMINA PERSERO PT 2.300% 09/02/2031 | USD | 26.190.761,42 | 0,37 |
| 5.950.000 | PERTAMINA PERSERO PT 4.700% 30/07/2049 EMTN | USD | 6.423.371,29 | 0,09 |
| 1.000.000 | PERTAMINA PERSERO PT 5.625% 20/05/2043 EMTN | USD | 1.187.314,10 | 0,02 |
| 3.000.000 | PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 3.550% 09/06/2051 | USD | 2.968.483,98 | 0,04 |
| 8.650.000 | PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 3.800% 24/06/2025 | USD | 8.817.487,79 | 0,13 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.200.000 | PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 5.625% 24/06/2030 | USD | 2.278.004,08 | 0,03 |
| 18.600.000 | PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.000% 30/06/2050 | USD | 17.832.643,79 | 0,25 |
| 5.850.000 | PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.375% 05/02/2050 EMTN | USD | 5.899.061,38 | 0,08 |
| 28.950.000 | PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 6.150% 21/05/2048 EMTN | USD | 35.759.993,03 | 0,52 |
| | | | **222.546.938,23** | **3,16** |
| | **Ukraine** | | | |
| 15.235.000 | STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE 6.250% 24/06/2028 | USD | 15.051.008,12 | 0,21 |
| 49.665.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 31/05/2040 FRN | USD | 54.004.369,62 | 0,77 |
| 1.000.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.375% 27/01/2030 | EUR | 1.072.911,50 | 0,02 |
| 10.485.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 20/06/2026 | EUR | 13.189.475,40 | 0,19 |
| 6.780.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.876% 21/05/2029 | USD | 6.865.718,93 | 0,10 |
| 49.693.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.253% 15/03/2033 | USD | 50.273.442,57 | 0,70 |
| 40.800.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 25/09/2032 | USD | 41.664.701,33 | 0,59 |
| 1.000.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 01/09/2025 | USD | 1.085.351,75 | 0,02 |
| 28.925.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 01/09/2027 | USD | 31.350.666,41 | 0,45 |
| | | | **214.557.645,63** | **3,05** |
| | **Katar** | | | |
| 15.230.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.392% 23/01/2026 | USD | 18.577.778,34 | 0,26 |
| 14.255.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.783% 23/01/2031 | USD | 16.082.277,32 | 0,23 |
| 2.500.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 14/03/2024 | USD | 2.658.382,88 | 0,04 |
| 5.000.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 14/03/2029 | USD | 5.690.307,55 | 0,08 |
| 45.910.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.817% 14/03/2049 | USD | 59.155.329,28 | 0,84 |
| 12.750.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.103% 23/04/2048 | USD | 16.946.632,41 | 0,24 |
| 10.800.000 | QATAR PETROLEUM 1.375% 12/09/2026 | USD | 10.722.201,55 | 0,15 |
| 24.650.000 | QATAR PETROLEUM 2.250% 12/07/2031 | USD | 24.385.034,93 | 0,35 |
| 28.100.000 | QATAR PETROLEUM 3.125% 12/07/2041 | USD | 28.124.260,14 | 0,40 |
| 29.600.000 | QATAR PETROLEUM 3.300% 12/07/2051 | USD | 29.943.121,72 | 0,43 |
| | | | **212.285.326,12** | **3,02** |
| | **Dominikanische Republik** | | | |
| 12.400.000 | BANCO DE RESERVAS DE LA REPUBLICA DOMINICANA 7.000% 01/02/2023 | USD | 13.009.284,29 | 0,18 |
| 21.000.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 4.500% 30/01/2030 | USD | 21.375.728,85 | 0,30 |
| 13.000.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 4.875% 23/09/2032 | USD | 13.292.666,53 | 0,19 |
| 21.400.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.300% 21/01/2041 | USD | 21.209.074,12 | 0,30 |
| 55.700.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2060 | USD | 54.633.690,34 | 0,79 |
| 11.500.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.000% 19/07/2028 | USD | 12.968.273,54 | 0,18 |
| 14.915.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.400% 05/06/2049 | USD | 15.795.617,69 | 0,22 |
| 12.875.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.500% 15/02/2048 | USD | 13.778.484,59 | 0,20 |
| 16.000.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.850% 27/01/2045 | USD | 17.857.766,08 | 0,25 |
| 14.000.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 7.450% 30/04/2044 | USD | 16.737.160,44 | 0,24 |
| | | | **200.657.746,47** | **2,85** |
| | **Bahrain** | | | |
| 20.700.000 | BAHRAIN GOVERMMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 30/09/2031 | USD | 20.517.152,76 | 0,29 |
| 14.985.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.250% 25/01/2028 EMTN | USD | 14.781.687,87 | 0,21 |
| 25.633.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 25/01/2033 EMTN | USD | 24.391.631,23 | 0,35 |
| 14.650.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 19/09/2044 | USD | 13.485.363,38 | 0,19 |
| 34.245.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 25/01/2051 EMTN | USD | 31.478.071,81 | 0,46 |
| 24.350.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 12/10/2028 | USD | 26.612.206,07 | 0,38 |
| 17.720.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 14/05/2030 | USD | 19.645.446,16 | 0,28 |
| 16.025.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 20/09/2047 | USD | 16.499.089,21 | 0,23 |
| 14.440.000 | CBB INTERNATIONAL SUKUK PROGRAMME CO SPC 6.250% 14/11/2024 | USD | 15.591.468,27 | 0,22 |
| 4.200.000 | CBB INTERNATIONAL SUKUK PROGRAMME CO WLL 4.500% 30/03/2027 | USD | 4.407.531,79 | 0,06 |
| 2.750.000 | OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE 7.625% 07/11/2024 | USD | 3.017.681,70 | 0,04 |
| | | | **190.427.330,25** | **2,71** |
| | **Ecuador** | | | |
| 39.149.999 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 31/07/2030 | USD | 20.820.573,55 | 0,30 |
| 81.000.000 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 31/07/2040 STEP-UP | USD | 47.702.598,57 | 0,68 |
| 119.454.681 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 31/07/2035 STEP-UP | USD | 78.774.026,24 | 1,11 |
| 45.746.790 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 31/07/2030 STEP-UP | USD | 38.495.912,35 | 0,55 |
| 518.733 | PETROAMAZONAS EP 4.625% 06/11/2020 | USD | 515.927,77 | 0,01 |
| | | | **186.309.038,48** | **2,65** |
| | **Saudi-Arabien** | | | |
| 11.180.000 | SAUDI ARABIAN OIL CO 2.250% 24/11/2030 | USD | 10.962.522,62 | 0,16 |
| 5.920.000 | SAUDI ARABIAN OIL CO 3.250% 24/11/2050 | USD | 5.671.115,68 | 0,08 |
| 9.850.000 | SAUDI ARABIAN OIL CO 3.500% 24/11/2070 | USD | 9.295.011,21 | 0,13 |
| 11.675.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.000% 09/07/2039 | EUR | 14.176.036,68 | 0,20 |
| 11.517.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.250% 02/02/2033 EMTN | USD | 11.209.907,14 | 0,16 |
| 3.800.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 03/02/2032 EMTN | USD | 3.909.434,49 | 0,06 |
| 23.506.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.450% 02/02/2061 EMTN | USD | 23.132.749,40 | 0,33 |
| 12.000.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 21/01/2055 EMTN | USD | 12.527.358,00 | 0,18 |
| 2.950.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 22/04/2060 EMTN | USD | 3.529.741,23 | 0,05 |
| 32.240.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 26/10/2046 EMTN | USD | 37.259.546,19 | 0,52 |
| 18.850.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.625% 04/10/2047 EMTN | USD | 22.188.554,79 | 0,32 |
| 9.120.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 17/04/2049 EMTN | USD | 11.370.630,59 | 0,16 |
| | | | **165.232.608,02** | **2,35** |
| | **Chile** | | | |
| 4.145.000 | AES ANDES SA 07/10/2079 FRN | USD | 4.386.467,93 | 0,06 |
| 3.100.000 | AES ANDES SA 26/03/2079 FRN | USD | 3.286.385,45 | 0,05 |
| 8.000.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.450% 31/01/2031 | USD | 7.934.279,04 | 0,11 |
| 16.213.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.100% 07/05/2041 | USD | 15.681.566,23 | 0,22 |
| 29.000.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.100% 22/01/2061 | USD | 26.262.110,58 | 0,37 |
| 9.270.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 21/09/2071 | USD | 8.417.212,47 | 0,12 |
| 5.611.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 15/04/2053 | USD | 5.628.470,91 | 0,08 |
| 34.600.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 25/01/2050 | USD | 34.667.354,78 | 0,50 |
| 18.900.000 | EMPRESA DE LOS FERROCARRILES DEL ESTADO 3.068% 18/08/2050 | USD | 16.820.319,60 | 0,24 |
| 25.940.000 | EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASAJEROS METRO SA 3.693% 13/09/2061 | USD | 25.398.225,46 | 0,36 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 13.500.000 | EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASAJEROS METRO SA 4.700% 07/05/2050 | USD | 15.993.067,55 | 0,23 |
| | | | **164.475.460,00** | **2,34** |
| | **Pakistan** | | | |
| 37.025.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 08/04/2026 EMTN | USD | 36.842.630,40 | 0,52 |
| 17.300.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 05/12/2027 | USD | 17.422.221,91 | 0,25 |
| 38.595.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 08/04/2031 EMTN | USD | 38.514.085,58 | 0,55 |
| 4.688.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 31/03/2036 | USD | 4.600.663,78 | 0,07 |
| 41.045.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 08/04/2051 EMTN | USD | 41.318.191,42 | 0,59 |
| 5.318.000 | PAKISTAN WATER & POWER DEVELOPMENT AUTHORITY 7.500% 04/06/2031 | USD | 5.269.548,50 | 0,07 |
| 13.950.000 | THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUKUK CO LTD/THE 5.625% 05/12/2022 | USD | 14.264.995,88 | 0,20 |
| | | | **158.232.337,47** | **2,25** |
| | **Vereinigte Arabische Emirate** | | | |
| 5.365.000 | ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.875% 15/09/2031 EMTN | USD | 5.238.646,74 | 0,07 |
| 1.370.000 | ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.500% 30/09/2029 | USD | 1.431.922,08 | 0,02 |
| 5.700.000 | ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.000% 15/09/2051 EMTN | USD | 5.601.513,52 | 0,08 |
| 53.740.000 | ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.125% 30/09/2049 | USD | 54.104.933,83 | 0,77 |
| 4.535.000 | ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 14/02/2051 EMTN | USD | 5.193.536,06 | 0,07 |
| 4.020.000 | ABU DHABI PORTS CO PJSC 2.500% 06/05/2031 EMTN | USD | 4.078.800,70 | 0,06 |
| 22.450.000 | EMIRATE OF DUBAI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.900% 09/09/2050 EMTN | USD | 21.249.563,70 | 0,30 |
| 20.181.000 | EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC 1.639% 15/06/2026 EMTN | USD | 20.271.295,85 | 0,29 |
| 7.900.000 | FINANCE DEPARTMENT GOVERNMENT OF SHARJAH MTN 4.000% 28/07/2050 | USD | 7.042.487,23 | 0,10 |
| 9.730.000 | FINANCE DEPARTMENT GOVERNMENT OF SHARJAH 3.625% 10/03/2033 EMTN | USD | 9.601.951,25 | 0,14 |
| 5.530.000 | FINANCE DEPARTMENT GOVERNMENT OF SHARJAH 4.375% 10/03/2051 EMTN | USD | 5.212.713,76 | 0,07 |
| 13.910.000 | NBK TIER 1 FINANCING LTD FRN PERP | USD | 13.905.827,70 | 0,20 |
| | | | **152.933.192,42** | **2,17** |
| | **Peru** | | | |
| 5.388.000 | CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA 15/07/2029 FRN | USD | 5.615.992,57 | 0,08 |
| 4.000.000 | CORP FINANCIERA DE DESARROLLO SA 2.000% 30/09/2030 | USD | 3.978.535,16 | 0,06 |
| 5.500.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.250% 11/03/2033 | EUR | 6.158.978,15 | 0,09 |
| 10.745.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.862% 01/12/2032 | USD | 9.805.602,04 | 0,14 |
| 55.300.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.780% 01/12/2060 | USD | 46.758.934,91 | 0,65 |
| 54.800.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.230% 28/07/2121 | USD | 45.569.077,00 | 0,65 |
| 4.900.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.300% 11/03/2041 | USD | 4.764.327,58 | 0,07 |
| 4.700.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.550% 10/03/2051 | USD | 4.679.023,15 | 0,07 |
| 19.598.000 | PETROLEOS DEL PERU SA 5.625% 19/06/2047 | USD | 19.586.691,17 | 0,28 |
| | | | **146.917.161,73** | **2,09** |
| | **Panama** | | | |
| 12.400.000 | AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCUMEN SA 5.125% 11/08/2061 | USD | 13.059.913,00 | 0,19 |
| 9.965.000 | BANCO NACIONAL DE PANAMA 2.500% 11/08/2030 | USD | 9.518.636,86 | 0,14 |
| 16.000.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.252% 29/09/2032 | USD | 15.061.281,12 | 0,21 |
| 9.500.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.362% 30/06/2031 | USD | 9.405.400,14 | 0,13 |
| 13.880.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.870% 23/07/2060 | USD | 13.571.197,20 | 0,19 |
| 21.650.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.870% 23/07/2060 | USD | 21.168.329,93 | 0,30 |
| 24.517.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.300% 29/04/2053 | USD | 25.998.863,38 | 0,37 |
| 14.000.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 01/04/2056 | USD | 15.198.920,24 | 0,22 |
| 11.150.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 16/04/2050 | USD | 12.139.466,50 | 0,17 |
| 8.000.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 28/04/2034 | USD | 11.530.971,68 | 0,16 |
| | | | **146.652.980,05** | **2,08** |
| | **Kolumbien** | | | |
| 9.000.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.000% 30/01/2030 | USD | 8.504.774,37 | 0,12 |
| 9.800.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.125% 15/04/2031 | USD | 9.179.537,11 | 0,13 |
| 13.630.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 22/04/2032 | USD | 12.726.834,22 | 0,18 |
| 27.300.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 15/02/2061 | USD | 22.091.700,54 | 0,31 |
| 18.800.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 15/05/2051 | USD | 16.264.047,32 | 0,23 |
| 20.100.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 22/02/2042 | USD | 18.089.828,35 | 0,26 |
| 43.900.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 15/06/2045 | USD | 42.861.049,87 | 0,61 |
| 2.500.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.200% 15/05/2049 | USD | 2.496.412,80 | 0,04 |
| 500.000 | ECOPETROL SA 6.875% 29/04/2030 | USD | 585.146,44 | 0,01 |
| 12.700.000 | EMPRESAS PUBLICAS DE MEDELLIN ESP 4.375% 15/02/2031 | USD | 12.555.955,97 | 0,18 |
| | | | **145.355.286,99** | **2,07** |
| | **Rumänien** | | | |
| 21.210.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.625% 02/12/2040 | EUR | 22.900.971,80 | 0,33 |
| 14.985.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 14/04/2041 EMTN | EUR | 16.133.505,58 | 0,23 |
| 17.085.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 13/04/2042 | EUR | 18.514.698,80 | 0,26 |
| 20.000.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 28/01/2050 EMTN | EUR | 22.843.067,76 | 0,32 |
| 11.000.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.624% 26/05/2030 | EUR | 14.362.569,39 | 0,20 |
| 4.650.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 29/10/2035 EMTN | EUR | 6.041.770,14 | 0,09 |
| 15.000.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 14/02/2051 | USD | 14.957.892,15 | 0,21 |
| 21.470.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.625% 03/04/2049 EMTN | EUR | 29.180.647,47 | 0,42 |
| | | | **144.935.123,09** | **2,06** |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 9.064.000 | CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD 2.125% 03/06/2026 | USD | 8.999.780,74 | 0,13 |
| 2.250.000 | CHINALCO CAPITAL HOLDINGS LTD 4.250% 21/04/2022 | USD | 2.284.934,42 | 0,03 |
| 1.300.000 | CNRC CAPITALE LTD FRN PERP | USD | 1.316.290,22 | 0,02 |
| 1.500.000 | DIANJIAN HAIYU LTD FRN PERP EMTN | USD | 1.514.882,40 | 0,02 |
| 1.865.000 | DIANJIAN INTERNATIONAL FINANCE LTD FRN PERP | USD | 1.930.263,68 | 0,03 |
| 3.200.000 | HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD FRN PERP | USD | 3.253.871,30 | 0,05 |
| 1.000.000 | HUARONG FINANCE 2017 CO LTD FRN PERP EMTN | USD | 922.823,36 | 0,01 |
| 3.000.000 | HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.750% 27/04/2027 | USD | 2.842.159,62 | 0,04 |
| 3.000.000 | HUARONG FINANCE 2017 CO LTD 4.950% 07/11/2047 EMTN | USD | 2.572.839,93 | 0,04 |
| 1.000.000 | HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.250% 13/11/2024 EMTN | USD | 932.602,40 | 0,01 |
| 13.200.000 | HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.375% 24/02/2030 EMTN | USD | 10.947.525,86 | 0,16 |
| 3.000.000 | HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.750% 29/05/2024 EMTN | USD | 2.850.351,39 | 0,04 |
| 3.000.000 | HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 3.875% 13/11/2029 EMTN | USD | 2.628.594,24 | 0,04 |
| 500.000 | HUARONG FINANCE 2019 CO LTD 4.500% 29/05/2029 EMTN | USD | 458.200,42 | 0,01 |
| 16.750.000 | TSINGHUA UNIC LTD 5.375% 31/01/2023 | USD | 7.248.800,02 | 0,10 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 91.200.000 | 1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.400% 09/03/2023 | USD | 91.858.004,35 | 1,30 |
| | | | **142.561.924,35** | **2,03** |
| | **Oman** | | | |
| 2.268.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 17/01/2023 | USD | 2.310.476,42 | 0,03 |
| 10.925.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN | USD | 11.351.764,37 | 0,16 |
| 11.500.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 08/03/2027 | USD | 11.996.857,50 | 0,17 |
| 7.100.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 17/01/2028 | USD | 7.374.732,37 | 0,10 |
| 6.000.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 01/08/2029 EMTN | USD | 6.301.316,70 | 0,09 |
| 12.895.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 25/01/2031 | USD | 13.770.739,17 | 0,20 |
| 15.415.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 08/03/2047 | USD | 14.899.248,32 | 0,21 |
| 41.525.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 17/01/2048 | USD | 41.037.180,91 | 0,58 |
| 12.930.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 25/01/2051 | USD | 13.128.889,13 | 0,19 |
| 14.475.000 | OMAN SOVEREIGN SUKUK CO 4.875% 15/06/2030 | USD | 15.233.327,74 | 0,22 |
| 4.775.000 | OQ SAOC 5.125% 06/05/2028 | USD | 4.837.873,14 | 0,07 |
| | | | **142.242.405,77** | **2,02** |
| | **Brasilien** | | | |
| 2.400.000 | BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN FRN PERP | USD | 2.392.015,56 | 0,03 |
| 3.600.000 | BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN 4.750% 20/03/2024 EMTN | USD | 3.830.527,15 | 0,05 |
| 12.000.000 | BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL SA 28/01/2031 FRN | USD | 12.051.446,52 | 0,17 |
| 6.940.000 | BANCO VOTORANTIM SA 4.375% 29/07/2025 EMTN | USD | 7.128.606,58 | 0,10 |
| 18.870.000 | BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 12/09/2031 | USD | 17.942.042,46 | 0,26 |
| 18.495.000 | BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 14/01/2050 | USD | 16.380.033,13 | 0,23 |
| 19.805.000 | BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 14/01/2050 | USD | 17.540.230,12 | 0,25 |
| 15.685.000 | BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 27/01/2045 | USD | 14.654.553,22 | 0,21 |
| 27.000.000 | BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 14/11/2024 | USD | 26.191.208,79 | 0,38 |
| 5.000.000 | BRF SA 4.875% 24/01/2030 | USD | 5.014.619,45 | 0,07 |
| 8.500.000 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA/CAYMAN ISLAND 21/11/2029 FRN | USD | 8.575.758,29 | 0,12 |
| | | | **131.701.041,27** | **1,87** |
| | **Südafrika** | | | |
| 27.518.000 | ESKOM HOLDINGS SOC LTD 6.750% 06/08/2023 EMTN | USD | 28.402.363,30 | 0,41 |
| 3.000.000 | ESKOM HOLDINGS SOC LTD 7.125% 11/02/2025 | USD | 3.124.810,62 | 0,04 |
| 15.129.000 | ESKOM HOLDINGS SOC LTD 8.450% 10/08/2028 | USD | 16.721.570,07 | 0,24 |
| 6.398.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.850% 30/09/2029 | USD | 6.578.843,50 | 0,09 |
| 1.100.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 24/07/2044 | USD | 1.036.762,94 | 0,01 |
| 9.150.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.650% 27/09/2047 | USD | 8.681.939,34 | 0,12 |
| 65.300.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 30/09/2049 | USD | 62.146.729,61 | 0,89 |
| | | | **126.693.019,38** | **1,80** |
| | **Argentinien** | | | |
| 37.476.300 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.125% 09/07/2030 | EUR | 15.775.052,98 | 0,22 |
| 19.592.060 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.750% 09/07/2035 STEP-UP | EUR | 7.263.718,54 | 0,10 |
| 6.470.459 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 09/07/2029 | USD | 2.484.363,01 | 0,04 |
| 185.000.000 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 09/07/2035 STEP-UP | USD | 60.402.516,65 | 0,85 |
| 40.000.000 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 09/07/2046 STEP-UP | USD | 13.283.703,20 | 0,19 |
| 46.015.220 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.500% 09/07/2041 STEP-UP | EUR | 18.089.434,75 | 0,26 |
| 88.000.000 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 15/12/2035 FRN | USD | 439.368,16 | 0,01 |
| 2.883.829 | PROVINCIA DE BUENOS AIRES/GOVERNMENT BONDS 2.850% 01/09/2037 EMTN STEP-UP | EUR | 1.359.018,57 | 0,02 |
| | | | **119.097.175,86** | **1,69** |
| | **Ghana** | | | |
| 22.860.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 07/04/2025 | USD | 17.635.267,45 | 0,25 |
| 5.680.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 11/02/2027 | USD | 5.358.060,38 | 0,08 |
| 910.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 26/03/2032 | USD | 863.082,49 | 0,01 |
| 17.145.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.625% 07/04/2034 | USD | 16.331.731,90 | 0,23 |
| 21.740.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.627% 16/06/2049 | USD | 19.420.109,38 | 0,28 |
| 21.015.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 11/03/2061 | USD | 18.715.287,99 | 0,27 |
| 26.400.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 07/05/2042 | USD | 24.550.834,18 | 0,35 |
| 16.445.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 26/03/2051 | USD | 14.957.131,55 | 0,21 |
| | | | **117.831.505,32** | **1,68** |
| | **Nigeria** | | | |
| 14.140.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 28/09/2028 EMTN | USD | 14.187.553,24 | 0,20 |
| 8.600.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 28/11/2027 EMTN | USD | 8.899.230,29 | 0,13 |
| 17.500.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 28/09/2033 EMTN | USD | 17.637.202,10 | 0,25 |
| 28.510.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 28/11/2047 EMTN | USD | 27.500.529,61 | 0,39 |
| 13.825.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.696% 23/02/2038 | USD | 13.677.626,19 | 0,19 |
| 1.000.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 16/02/2032 | USD | 1.038.927,12 | 0,01 |
| 29.145.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/09/2051 EMTN | USD | 29.353.377,42 | 0,43 |
| 2.165.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.248% 21/01/2049 | USD | 2.348.288,62 | 0,03 |
| | | | **114.642.734,59** | **1,63** |
| | **Sri Lanka** | | | |
| 800.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 18/01/2022 | USD | 709.836,54 | 0,01 |
| 13.500.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 18/04/2023 | USD | 8.911.504,58 | 0,13 |
| 1.800.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 03/06/2025 | USD | 1.134.736,78 | 0,02 |
| 21.775.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.200% 11/05/2027 | USD | 13.301.746,95 | 0,19 |
| 6.775.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.350% 28/06/2024 | USD | 4.337.008,12 | 0,06 |
| 41.285.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 18/04/2028 | USD | 25.220.853,33 | 0,35 |
| 6.600.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.825% 18/07/2026 | USD | 4.099.287,79 | 0,06 |
| 21.977.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 03/11/2025 | USD | 13.850.320,55 | 0,20 |
| 18.950.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 14/03/2024 | USD | 12.084.125,44 | 0,17 |
| 15.250.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.550% 28/03/2030 | USD | 9.312.163,01 | 0,13 |
| 17.200.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.850% 14/03/2029 | USD | 10.500.112,55 | 0,15 |
| 11.500.000 | SRILANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024 | USD | 7.069.961,15 | 0,10 |
| | | | **110.531.656,79** | **1,57** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 9.974.231 | BIOCEANICO SOVEREIGN CERTIFICATE LTD ZCP 05/06/2034 | USD | 7.478.982,26 | 0,11 |
| 25.017.000 | CHINA EVERGRANDE GROUP 8.750% 28/06/2025 | USD | 6.010.159,88 | 0,09 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 7.500.000 | DUBAI DOF SUKUK LTD 2.763% 09/09/2030 EMTN | USD | 7.622.140,88 | 0,11 |
| 8.740.261 | INTEROCEANICA IV FINANCE LTD ZCP 30/11/2025 | USD | 8.057.569,24 | 0,11 |
| 5.000.000 | KAISA GROUP HOLDING LTD 9.375% 30/06/2024 | USD | 3.875.000,00 | 0,06 |
| 1.000.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.250% 16/04/2025 | USD | 775.970,41 | 0,01 |
| 12.417.000 | KSA SUKUK LTD 2.969% 29/10/2029 EMTN | USD | 13.133.354,98 | 0,19 |
| 1.563.000 | MALDIVES SUKUK ISSUANCE LTD 9.875% 08/04/2026 | USD | 1.581.237,85 | 0,02 |
| 6.600.000 | MUMTALAKAT SUKUK HOLDING CO 5.625% 27/02/2024 | USD | 6.974.903,63 | 0,10 |
| 1.429.751.802 | NEON CAPITAL LTD/KY ZCP 06/01/2028 | JPY | 10.664.032,71 | 0,14 |
| 3.000.000 | ORYX FUNDING LTD 5.800% 03/02/2031 | USD | 3.174.071,22 | 0,05 |
| 6.210.359 | PERU ENHANCED PASS-THROUGH FINANCE LTD ZCP 02/06/2025 | USD | 5.940.610,76 | 0,08 |
| 11.993.000 | SA GLOBAL SUKUK LTD 0.946% 17/06/2024 | USD | 11.879.772,65 | 0,17 |
| 14.773.000 | SA GLOBAL SUKUK LTD 1.602% 17/06/2026 | USD | 14.705.856,86 | 0,21 |
| 6.800.000 | SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD 5.200% 16/01/2027 | USD | 6.587.095,20 | 0,09 |
| | | | **108.460.758,53** | **1,54** |
| | **Hongkong** | | | |
| 31.000.000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 3.875% 19/06/2029 | USD | 33.181.505,65 | 0,47 |
| 36.727.000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.125% 19/07/2027 | USD | 40.160.469,14 | 0,57 |
| 16.735.000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.875% 14/03/2025 | USD | 18.381.690,03 | 0,26 |
| 4.765.000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 5.125% 14/03/2028 | USD | 5.447.066,01 | 0,08 |
| | | | **97.170.730,83** | **1,38** |
| | **Jordanien** | | | |
| 14.770.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 07/07/2025 | USD | 15.406.850,20 | 0,22 |
| 45.975.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.850% 07/07/2030 | USD | 47.712.785,58 | 0,68 |
| 20.950.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 10/10/2047 | USD | 21.708.896,15 | 0,31 |
| | | | **84.828.531,93** | **1,21** |
| | **Russland** | | | |
| 14.000.000 | RUSSIAN FOREIGN BOND - EUROBOND 4.375% 21/03/2029 | USD | 15.869.570,78 | 0,23 |
| 2.000.000 | RUSSIAN FOREIGN BOND - EUROBOND 4.750% 27/05/2026 | USD | 2.252.630,30 | 0,03 |
| 52.000.000 | RUSSIAN FOREIGN BOND - EUROBOND 5.250% 23/06/2047 | USD | 66.056.304,08 | 0,94 |
| | | | **84.178.505,16** | **1,20** |
| | **Kasachstan** | | | |
| 6.145.000 | KAZAKHSTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 14/10/2044 | USD | 7.565.900,73 | 0,11 |
| 5.430.000 | KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC 3.500% 14/04/2033 | USD | 5.611.200,57 | 0,08 |
| 49.164.000 | KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC 5.750% 19/04/2047 | USD | 59.355.675,57 | 0,84 |
| 1.000.000 | KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC 6.375% 24/10/2048 | USD | 1.289.731,66 | 0,02 |
| | | | **73.822.508,53** | **1,05** |
| | **Philippinen** | | | |
| 2.000.000 | GLOBE TELECOM INC 3.000% 23/07/2035 | USD | 1.856.528,06 | 0,03 |
| 1.300.000 | PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.648% 10/06/2031 | USD | 1.240.639,53 | 0,02 |
| 7.650.000 | PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.750% 28/04/2041 | EUR | 8.846.568,71 | 0,13 |
| 3.750.000 | PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.252% 29/09/2032 | USD | 3.574.026,56 | 0,05 |
| 22.750.000 | PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.650% 10/12/2045 | USD | 20.794.103,33 | 0,29 |
| 1.000.000 | PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.700% 01/03/2041 | USD | 1.060.923,06 | 0,02 |
| 23.064.000 | POWER SECTOR ASSETS & LIABILITIES MANAGEMENT CORP 9.625% 15/05/2028 | USD | 33.755.229,33 | 0,47 |
| | | | **71.128.018,58** | **1,01** |
| | **Paraguay** | | | |
| 15.409.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 28/04/2031 | USD | 17.399.016,88 | 0,25 |
| 16.000.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.739% 29/01/2033 | USD | 15.365.316,00 | 0,22 |
| 23.300.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.400% 30/03/2050 | USD | 26.719.101,65 | 0,38 |
| 5.600.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.600% 13/03/2048 | USD | 6.488.655,32 | 0,09 |
| | | | **65.972.089,85** | **0,94** |
| | **Uruguay** | | | |
| 49.500.000 | URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.975% 20/04/2055 | USD | 62.071.872,39 | 0,89 |
| 2.500.000 | URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/03/2036 | USD | 3.744.449,50 | 0,05 |
| | | | **65.816.321,89** | **0,94** |
| | **El Salvador** | | | |
| 11.650.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2025 | USD | 8.913.631,57 | 0,13 |
| 6.950.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 18/01/2027 | USD | 5.185.394,24 | 0,07 |
| 23.000.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.125% 20/01/2050 | USD | 15.844.776,59 | 0,23 |
| 19.500.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 01/02/2041 | USD | 13.684.366,02 | 0,19 |
| 8.605.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/09/2034 | USD | 6.218.555,39 | 0,09 |
| 300.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 24/01/2023 | USD | 252.886,56 | 0,00 |
| 10.000.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.500% 15/07/2052 | USD | 7.788.900,30 | 0,11 |
| | | | **57.888.510,67** | **0,82** |
| | **Niederlande** | | | |
| 8.600.000 | MDGH - GMTN BV 2.875% 21/05/2030 GMTN | USD | 9.071.698,73 | 0,13 |
| 8.590.000 | MDGH - GMTN BV 3.700% 07/11/2049 | USD | 9.387.249,07 | 0,13 |
| 11.700.000 | MDGH - GMTN BV 3.950% 21/05/2050 GMTN | USD | 13.321.814,81 | 0,19 |
| 5.400.000 | MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 10/08/2030 | USD | 5.587.166,81 | 0,08 |
| 19.550.000 | PETROBRAS GLOBAL FINANCE BV 6.850% 05/06/2115 | USD | 20.192.349,07 | 0,29 |
| | | | **57.560.278,49** | **0,82** |
| | **Guatemela** | | | |
| 2.000.000 | GUATEMALA GOVERNMENT BOND 4.900% 01/06/2030 | USD | 2.164.811,56 | 0,03 |
| 5.000.000 | GUATEMALA GOVERNMENT BOND 5.375% 24/04/2032 | USD | 5.568.413,35 | 0,08 |
| 42.000.000 | GUATEMALA GOVERNMENT BOND 6.125% 01/06/2050 | USD | 48.384.614,88 | 0,69 |
| | | | **56.117.839,79** | **0,80** |
| | **Malaysia** | | | |
| 1.000.000 | DUA CAPITAL LTD 1.658% 11/05/2026 | USD | 991.217,02 | 0,01 |
| 4.000.000 | DUA CAPITAL LTD 2.780% 11/05/2031 | USD | 3.968.853,52 | 0,06 |
| 9.600.000 | MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD 2.070% 28/04/2031 | USD | 9.538.429,73 | 0,14 |
| 6.700.000 | MALAYSIA WAKALA SUKUK BHD 3.075% 28/04/2051 | USD | 6.813.234,69 | 0,10 |
| 11.350.000 | PETRONAS CAPITAL LTD 3.404% 28/04/2061 EMTN | USD | 11.466.005,29 | 0,15 |
| 2.925.000 | PETRONAS CAPITAL LTD 3.500% 21/04/2030 EMTN | USD | 3.175.176,48 | 0,05 |
| 10.895.000 | PETRONAS CAPITAL LTD 4.550% 21/04/2050 EMTN | USD | 13.318.456,56 | 0,19 |
| 775.000 | PETRONAS CAPITAL LTD 4.800% 21/04/2060 EMTN | USD | 1.011.734,80 | 0,01 |
| | | | **50.283.108,09** | **0,71** |
| | **Marokko** | | | |
| 17.000.000 | MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.375% 15/12/2027 | USD | 16.655.752,72 | 0,24 |
| 8.076.000 | MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.000% 15/12/2032 | USD | 7.675.263,15 | 0,11 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 18.425.000 | MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 15/12/2050 | USD | 16.844.399,21 | 0,24 |
| 8.159.000 | OCP SA 5.125% 23/06/2051 | USD | 8.076.107,17 | 0,11 |
| | | | **49.251.522,25** | **0,70** |
| | **Weißrussland** | | | |
| 2.705.000 | DEVELOPMENT BANK OF THE REPUBLIC OF BELARUS JSC 6.750% 02/05/2024 | USD | 2.546.552,16 | 0,04 |
| 5.866.000 | REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 5.875% 24/02/2026 | USD | 5.514.629,53 | 0,08 |
| 28.005.000 | REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 6.378% 24/02/2031 | USD | 24.652.066,93 | 0,35 |
| 13.850.000 | REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 7.625% 29/06/2027 | USD | 13.693.500,96 | 0,19 |
| | | | **46.406.749,58** | **0,66** |
| | **Angola** | | | |
| 5.120.000 | ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.000% 26/11/2029 EMTN | USD | 5.253.571,12 | 0,07 |
| 33.860.000 | ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.125% 26/11/2049 EMTN | USD | 34.384.459,91 | 0,49 |
| 6.065.000 | ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 08/05/2048 | USD | 6.262.016,13 | 0,09 |
| | | | **45.900.047,16** | **0,65** |
| | **Bermuda** | | | |
| 9.000.000 | BERMUDA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.375% 20/08/2030 | USD | 8.936.375,04 | 0,13 |
| 28.500.000 | BERMUDA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 20/08/2050 | USD | 28.590.285,72 | 0,41 |
| 6.300.000 | INKIA ENERGY LTD 5.875% 09/11/2027 | USD | 6.546.032,39 | 0,09 |
| | | | **44.072.693,15** | **0,63** |
| | **Costa Rica** | | | |
| 7.447.245 | AUTOPISTAS DEL SOL SA/COSTA RICA 7.375% 30/12/2030 | USD | 7.773.911,35 | 0,11 |
| 11.000.000 | COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 30/04/2043 | USD | 9.740.700,20 | 0,14 |
| 6.000.000 | COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 19/02/2031 | USD | 6.158.580,54 | 0,09 |
| 1.500.000 | COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 04/04/2044 | USD | 1.481.199,17 | 0,02 |
| 1.100.000 | COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.158% 12/03/2045 | USD | 1.102.289,64 | 0,02 |
| 15.795.000 | INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD 6.375% 15/05/2043 | USD | 13.654.880,01 | 0,19 |
| | | | **39.911.560,91** | **0,57** |
| | **Benin** | | | |
| 8.965.000 | BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 19/01/2032 | EUR | 10.360.634,35 | 0,15 |
| 17.751.000 | BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 22/01/2035 | EUR | 20.057.542,56 | 0,29 |
| 7.253.000 | BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 19/01/2052 | EUR | 8.658.529,86 | 0,12 |
| | | | **39.076.706,77** | **0,56** |
| | **Bahamas** | | | |
| 14.900.000 | BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 21/11/2028 | USD | 12.809.645,33 | 0,18 |
| 27.800.000 | BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 15/10/2032 | USD | 26.132.000,00 | 0,37 |
| | | | **38.941.645,33** | **0,55** |
| | **Kenia** | | | |
| 21.390.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.300% 23/01/2034 | USD | 21.119.819,49 | 0,30 |
| 7.635.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.000% 22/05/2032 | USD | 8.442.263,36 | 0,12 |
| 8.240.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/02/2048 | USD | 8.915.583,43 | 0,13 |
| | | | **38.477.666,28** | **0,55** |
| | **Aserbaidschan** | | | |
| 8.900.000 | REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 3.500% 01/09/2032 | USD | 9.070.612,20 | 0,13 |
| 13.000.000 | REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 5.125% 01/09/2029 | USD | 14.508.658,32 | 0,20 |
| 6.500.000 | SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC 6.875% 24/03/2026 | USD | 7.660.865,23 | 0,11 |
| 1.500.000 | STATE OIL CO OF THE AZERBAIJAN REPUBLIC 6.950% 18/03/2030 | USD | 1.848.434,33 | 0,03 |
| | | | **33.088.570,08** | **0,47** |
| | **Trinidad und Tobago** | | | |
| 25.125.000 | TRINIDAD & TOBAGO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 26/06/2030 | USD | 26.556.311,20 | 0,38 |
| 3.888.000 | TRINIDAD PETROLEUM HOLDINGS LTD 9.750% 15/06/2026 | USD | 4.352.430,39 | 0,06 |
| | | | **30.908.741,59** | **0,44** |
| | **Montenegro** | | | |
| 27.410.000 | MONTENEGRO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 16/12/2027 | EUR | 29.880.681,57 | 0,42 |
| | | | **29.880.681,57** | **0,42** |
| | **Jamaika** | | | |
| 20.500.000 | JAMAICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 28/07/2045 | USD | 28.514.844,82 | 0,41 |
| | | | **28.514.844,82** | **0,41** |
| | **Libanon** | | | |
| 1.000.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.800% 14/04/2020 GMTN | USD | 165.282,94 | 0,00 |
| 15.816.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.150% 19/06/2020 GMTN | USD | 2.613.444,70 | 0,04 |
| 5.201.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 01/01/2025 GMTN | USD | 867.297,90 | 0,01 |
| 14.250.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.650% 03/11/2028 GMTN | USD | 2.382.604,85 | 0,03 |
| 29.640.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.650% 22/04/2024 | USD | 4.951.244,03 | 0,07 |
| 79.182.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.250% 23/03/2037 | USD | 14.274.876,32 | 0,21 |
| 11.356.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 12/04/2021 EMTN | USD | 1.933.683,67 | 0,03 |
| | | | **27.188.434,41** | **0,39** |
| | **Republik Serbien** | | | |
| 6.690.000 | SERBIA INTERNATIONAL BOND 1.650% 03/03/2033 | EUR | 7.367.848,47 | 0,10 |
| 21.000.000 | SERBIA INTERNATIONAL BOND 2.125% 01/12/2030 | USD | 19.664.888,04 | 0,28 |
| | | | **27.032.736,51** | **0,38** |
| | **Sambia** | | | |
| 34.375.000 | ZAMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.970% 30/07/2027 | USD | 26.491.551,63 | 0,38 |
| | | | **26.491.551,63** | **0,38** |
| | **Irland** | | | |
| 12.520.000 | CREDIT BANK OF MOSCOW 3.875% 21/09/2026 | USD | 12.369.833,24 | 0,18 |
| 3.823.031 | SADEREA DAC 12.500% 30/11/2026 EMTN | USD | 4.133.247,75 | 0,06 |
| 2.930.000 | TINKOFF BANK JSC VIA TCS FINANCE LTD FRN PERP | USD | 2.926.799,36 | 0,04 |
| 6.400.000 | VNESHECONOMBANK VIA VEB FINANCE PLC 5.942% 21/11/2023 | USD | 6.972.658,43 | 0,10 |
| | | | **26.402.538,78** | **0,38** |
| | **Venezuela** | | | |
| 42.775.000 | PETROLEOS DE VENEZUELA SA 5.500% 12/04/2037 - DEFAULTED | USD | 2.279.573,43 | 0,03 |
| 48.620.000 | PETROLEOS DE VENEZUELA SA 6.000% 16/05/2024 - DEFAULTED | USD | 2.809.435,23 | 0,04 |
| 8.635.000 | PETROLEOS DE VENEZUELA SA 8.500% 27/10/2020 | USD | 2.166.076,71 | 0,03 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 11.475.000 | PETROLEOS DE VENEZUELA SA 9.000% 17/11/2021 - DEFAULTED | USD | 659.812,50 | 0,01 |
| 92.760.000 | VENEZUELA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.250% 15/09/2027 - DEFAULTED | USD | 9.837.492,98 | 0,14 |
| 66.075.000 | VENEZUELA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 13/01/2034 - DEFAULTED | USD | 7.095.826,63 | 0,10 |
| | | | **24.848.217,48** | **0,35** |
| | **Elfenbeinküste** | | | |
| 5.240.000 | IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 30/01/2032 | EUR | 5.922.194,14 | 0,08 |
| 7.460.000 | IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 22/03/2048 | EUR | 8.699.802,90 | 0,12 |
| 7.545.000 | IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 17/10/2040 | EUR | 9.342.562,31 | 0,14 |
| | | | **23.964.559,35** | **0,34** |
| | **Armenien** | | | |
| 24.974.000 | REPUBLIC OF ARMENIA INTERNATIONAL BOND 3.600% 02/02/2031 | USD | 23.662.984,13 | 0,34 |
| | | | **23.662.984,13** | **0,34** |
| | **Papua-Neuguinea** | | | |
| 22.330.000 | PAPUA NEW GUINEA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.375% 04/10/2028 | USD | 22.404.556,74 | 0,32 |
| | | | **22.404.556,74** | **0,32** |
| | **Irak** | | | |
| 22.729.688 | IRAQ INTERNATIONAL BOND 5.800% 15/01/2028 | USD | 21.928.638,53 | 0,31 |
| | | | **21.928.638,53** | **0,31** |
| | **Jersey** | | | |
| 9.817.000 | GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.160% 31/03/2034 | USD | 9.655.760,78 | 0,15 |
| 9.488.000 | GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.940% 30/09/2040 | USD | 9.484.861,46 | 0,13 |
| 1.800.000 | WEST CHINA CEMENT LTD 4.950% 08/07/2026 | USD | 1.753.390,55 | 0,02 |
| | | | **20.894.012,79** | **0,30** |
| | **Ungarn** | | | |
| 4.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.500% 17/11/2050 | EUR | 4.316.830,46 | 0,06 |
| 7.300.000 | HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.125% 22/09/2031 | USD | 7.197.766,27 | 0,10 |
| 8.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.125% 21/09/2051 | USD | 7.892.509,84 | 0,11 |
| | | | **19.407.106,57** | **0,27** |
| | **Tunesien** | | | |
| 2.200.000.000 | BANQUE CENTRALE DE TUNISIE INTERNATIONAL BOND 3.500% 03/02/2033 | JPY | 11.034.858,88 | 0,16 |
| 2.900.000 | BANQUE CENTRALE DE TUNISIE INTERNATIONAL BOND 5.625% 17/02/2024 | EUR | 2.848.406,86 | 0,04 |
| 3.500.000 | BANQUE CENTRALE DE TUNISIE INTERNATIONAL BOND 5.750% 30/01/2025 | USD | 2.952.358,12 | 0,04 |
| | | | **16.835.623,86** | **0,24** |
| | **Indien** | | | |
| 17.600.000 | EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 2.250% 13/01/2031 EMTN | USD | 16.384.325,23 | 0,23 |
| | | | **16.384.325,23** | **0,23** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.700.000 | FRESNILLO PLC 4.250% 02/10/2050 | USD | 1.772.628,06 | 0,03 |
| 5.005.000 | STATE SAVINGS BANK OF UKRAINE VIA SSB #1 PLC 9.625% 20/03/2025 STEP-UP | USD | 5.391.481,75 | 0,07 |
| 4.450.000 | UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 7.875% 15/07/2026 | USD | 4.509.541,80 | 0,06 |
| 4.000.000 | UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 8.250% 09/07/2024 | USD | 4.170.801,48 | 0,06 |
| | | | **15.844.453,09** | **0,22** |
| | **Albanien** | | | |
| 12.500.000 | ALBANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 16/06/2027 | EUR | 15.615.675,96 | 0,22 |
| | | | **15.615.675,96** | **0,22** |
| | **Senegal** | | | |
| 11.971.000 | SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 08/06/2037 | EUR | 13.697.829,90 | 0,20 |
| 1.725.000 | SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 13/03/2048 | USD | 1.742.941,24 | 0,02 |
| | | | **15.440.771,14** | **0,22** |
| | **Japan** | | | |
| 2.500.000 | NIPPON LIFE INSURANCE CO 16/09/2051 FRN | USD | 2.464.264,93 | 0,04 |
| 13.000.000 | SOFTBANK GROUP CORP 5.250% 06/07/2031 | USD | 12.893.397,27 | 0,18 |
| | | | **15.357.662,20** | **0,22** |
| | **Honduras** | | | |
| 7.000.000 | HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 24/06/2030 | USD | 7.312.376,26 | 0,10 |
| 7.400.000 | HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 19/01/2027 | USD | 8.035.063,63 | 0,12 |
| | | | **15.347.439,89** | **0,22** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 3.143.000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 2.634% 17/05/2026 | USD | 3.212.818,04 | 0,04 |
| 6.465.000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 3.798% 17/05/2031 | USD | 6.704.162,72 | 0,09 |
| 2.200.000 | BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 3.500% 25/06/2024 | USD | 2.323.386,08 | 0,03 |
| | | | **12.240.366,84** | **0,16** |
| | **Mosambik** | | | |
| 12.400.000 | MOZAMBIQUE INTERNATIONAL BOND 5.000% 15/09/2031 STEP-UP | USD | 10.671.484,64 | 0,15 |
| | | | **10.671.484,64** | **0,15** |
| | **Mazedonien** | | | |
| 7.335.000 | NORTH MACEDONIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.625% 10/03/2028 | EUR | 8.300.085,30 | 0,12 |
| | | | **8.300.085,30** | **0,12** |
| | **Mongolei** | | | |
| 4.000.000 | MONGOLIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 07/07/2027 | USD | 3.881.384,00 | 0,05 |
| 3.550.000 | MONGOLIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.450% 07/07/2031 | USD | 3.443.879,60 | 0,05 |
| | | | **7.325.263,60** | **0,10** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 4.836.875 | BRAZIL LOAN TRUST 1 5.477% 24/07/2023 | USD | 4.990.636,24 | 0,07 |
| 2.000.000 | SK BATTERY AMERICA INC 2.125% 26/01/2026 | USD | 1.976.583,22 | 0,03 |
| | | | **6.967.219,46** | **0,10** |
| | **China** | | | |
| 6.500.000 | CHINA MINMETALS CORP FRN PERP | USD | 6.635.058,89 | 0,09 |
| | | | **6.635.058,89** | **0,09** |
| | **Tadschikistan** | | | |
| 6.640.000 | REPUBLIC OF TAJIKISTAN INTERNATIONAL BOND 7.125% 14/09/2027 | USD | 5.961.720,48 | 0,08 |
| | | | **5.961.720,48** | **0,08** |
| | **Gabun** | | | |
| 5.185.000 | GABON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.950% 16/06/2025 | USD | 5.613.393,77 | 0,08 |
| | | | **5.613.393,77** | **0,08** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Uzbekistan** | | | |
| 5.621.000 | REPUBLIC OF UZBEKISTAN INTERNATIONAL BOND 3.900% 19/10/2031 | USD | 5.488.929,88 | 0,08 |
| | | | **5.488.929,88** | **0,08** |
| | **Spanien** | | | |
| 4.254.000 | AI CANDELARIA SPAIN SLU 7.500% 15/12/2028 | USD | 4.634.951,23 | 0,07 |
| | | | **4.634.951,23** | **0,07** |
| | **Kanada** | | | |
| 4.000.000 | PETRONAS ENERGY CANADA LTD 2.112% 23/03/2028 EMTN | USD | 4.010.087,28 | 0,06 |
| | | | **4.010.087,28** | **0,06** |
| | **Bolivien** | | | |
| 3.500.000 | BOLIVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 20/03/2028 | USD | 3.179.456,91 | 0,05 |
| | | | **3.179.456,91** | **0,05** |
| | **Georgien** | | | |
| 2.742.000 | GEORGIAN RAILWAY JSC 4.000% 17/06/2028 | USD | 2.788.901,09 | 0,04 |
| | | | **2.788.901,09** | **0,04** |
| | **Israel** | | | |
| 1.500.000 | ISRAEL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 03/07/2050 | USD | 1.885.807,28 | 0,03 |
| | | | **1.885.807,28** | **0,03** |
| | **Bosnien** | | | |
| 1.311.833 | BOSNIA & HERZEGOVINA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.250% 20/12/2021 | DEM | 684.056,26 | 0,01 |
| | | | **684.056,26** | **0,01** |
| | | | **6.062.717.011,02** | **86,19** |

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Anleihen und andere Schuldtitel

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | **Tunesien** | | | |
| 730.000.000 | BANQUE CENTRALE DE TUNISIE INTERNATIONAL BOND 4.300% 02/08/2030 | JPY | 4.841.685,69 | 0,07 |
| | | | **4.841.685,69** | **0,07** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 3.850.000 | BRAZIL MINAS SPE VIA STATE OF MINAS GERAIS 5.333% 15/02/2028 | USD | 4.131.921,80 | 0,06 |
| | | | **4.131.921,80** | **0,06** |
| | **Argentinien** | | | |
| 1.135.127.000 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 15/12/2035 FRN | JPY | 27.538,70 | 0,00 |
| | | | **27.538,70** | **0,00** |
| | | | **9.001.146,19** | **0,13** |

#### Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Offene Fonds

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | **Luxemburg** | | | |
| 1.472 | NN (L) ASIAN DEBT (HARD CURRENCY) - Z CAP USD | USD | 8.156.381,44 | 0,12 |
| 13.916 | NN (L) EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT - Z CAP USD | USD | 101.932.993,51 | 1,45 |
| 17.858 | NN (L) EMERGING MARKETS DEBT SHORT DURATION (HARD CURRENCY) - Z CAP USD | USD | 98.761.364,95 | 1,40 |
| 28.737 | NN (L) FRONTIER MARKETS DEBT (HARD CURRENCY) - I CAP USD | USD | 233.111.359,93 | 3,31 |
| | | | **441.962.099,83** | **6,28** |
| | | | **441.962.099,83** | **6,28** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **6.513.680.257,04** | **92,60** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeich-nung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeits-datum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swaps** | | | | | | |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 137.500.000,00 | 5.467.522,50 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 72.500.000,00 | 2.882.875,50 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 72.500.000,00 | 2.882.875,50 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 71.000.000,00 | 2.823.229,80 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 70.000.000,00 | 2.783.466,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 70.000.000,00 | 2.783.466,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 70.000.000,00 | 2.783.466,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 65.000.000,00 | 2.584.647,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 65.000.000,00 | 2.584.647,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 62.000.000,00 | 2.465.355,60 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 60.000.000,00 | 2.385.828,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 60.000.000,00 | 2.385.828,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 60.000.000,00 | 2.385.828,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 35 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/06/2026 | USD | 70.000.000,00 | 2.251.427,50 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 35 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/06/2026 | USD | 60.000.000,00 | 1.929.795,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 35 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/06/2026 | USD | 60.000.000,00 | 1.929.795,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 35 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 35.000.000,00 | 1.391.733,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 35 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/06/2026 | USD | 40.000.000,00 | 1.286.530,00 |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 35 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/06/2026 | USD | 35.000.000,00 | 1.125.713,75 |
| CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 15.000.000,00 | (409.023,75) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 50.000.000,00 | (1.363.412,50) |
| CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 50.000.000,00 | (1.363.412,50) |
| CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 75.000.000,00 | (2.045.118,75) |
| | | | | | | **41.933.061,65** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | **Devisentermingeschäfte** | | |
| 231.374.499,24 | USD | 3.315.698.927,15 | ZAR | 19/10/2021 | 231.374.499,24 | 11.457.835,91 |
| 158.392.931,20 | USD | 134.000.000,00 | EUR | 29/10/2021 | 158.392.931,20 | 3.018.002,22 |
| 289.007.290,00 | USD | 247.000.000,00 | EUR | 29/11/2021 | 289.007.290,00 | 2.429.791,09 |
| 27.308.672,43 | USD | 2.995.000.000,00 | JPY | 29/10/2021 | 27.308.672,43 | 461.028,56 |
| 24.775.047,61 | USD | 33.696.506,97 | AUD | 19/10/2021 | 24.775.047,61 | 432.820,39 |
| 20.707.151,40 | USD | 17.765.791,33 | EUR | 19/10/2021 | 20.707.151,40 | 111.400,99 |
| 3.711.076,29 | USD | 2.700.000,00 | GBP | 29/10/2021 | 3.711.076,29 | 70.407,59 |
| 6.073.870,87 | ZAR | 400.189,15 | USD | 04/10/2021 | 400.189,15 | 3.524,43 |
| 1.707.856,01 | USD | 2.360.058,05 | AUD | 01/10/2021 | 1.707.856,01 | 3.068,75 |
| 535.159,15 | AUD | 384.699,15 | USD | 05/10/2021 | 384.699,15 | 1.874,59 |
| 1.607.898,91 | USD | 6.378.890,50 | PLN | 19/10/2021 | 1.607.898,91 | 1.667,23 |
| 35.629,14 | USD | 768.414,49 | CZK | 19/10/2021 | 35.629,14 | 507,95 |
| 655.786,82 | ZAR | 43.436,78 | USD | 01/10/2021 | 43.436,78 | 151,58 |
| 19.719,48 | USD | 16.892,52 | EUR | 01/10/2021 | 19.719,48 | 141,89 |
| 134.839,09 | CZK | 6.142,42 | USD | 04/10/2021 | 6.142,42 | 23,85 |
| 282,32 | USD | 6.169,80 | CZK | 01/10/2021 | 282,32 | 0,17 |
| 7.176,72 | USD | 6.696,67 | CHF | 19/10/2021 | 7.176,72 | (4,77) |
| 3.624,53 | USD | 2.700,21 | GBP | 19/10/2021 | 3.624,53 | (16,37) |
| 14.435,18 | AUD | 10.446,02 | USD | 01/10/2021 | 10.446,02 | (18,77) |
| 250.405,84 | EUR | 290.858,91 | USD | 04/10/2021 | 290.858,91 | (651,06) |
| 116.550,99 | GBP | 160.695,14 | USD | 19/10/2021 | 160.695,14 | (3.540,60) |
| 426.878,58 | EUR | 498.316,71 | USD | 01/10/2021 | 498.316,71 | (3.585,78) |
| 1.654.340,09 | USD | 2.301.370,37 | AUD | 05/10/2021 | 1.654.340,09 | (8.061,35) |
| 683.136,36 | CHF | 746.534,42 | USD | 19/10/2021 | 746.534,42 | (13.940,65) |
| 3.000.000,00 | EUR | 3.502.245,00 | USD | 29/11/2021 | 3.502.245,00 | (21.546,64) |
| 60.084.197,89 | CZK | 2.804.239,63 | USD | 19/10/2021 | 2.804.239,63 | (58.028,45) |
| 27.047.863,04 | USD | 408.355.112,25 | ZAR | 01/10/2021 | 27.047.863,04 | (94.384,37) |
| 28.854.875,79 | USD | 437.944.877,30 | ZAR | 04/10/2021 | 28.854.875,79 | (254.122,37) |
| 20.000.000,00 | EUR | 23.527.899,00 | USD | 29/10/2021 | 23.527.899,00 | (337.611,09) |
| 240.301.834,86 | PLN | 63.222.809,56 | USD | 19/10/2021 | 63.222.809,56 | (2.713.788,58) |
| 443.195.700,15 | AUD | 326.671.437,18 | USD | 19/10/2021 | 326.671.437,18 | (6.508.565,63) |
| 2.464.643.225,14 | EUR | 2.924.338.686,27 | USD | 19/10/2021 | 2.924.338.686,27 | (67.096.034,58) |
| 28.226.236.711,88 | ZAR | 1.943.614.233,79 | USD | 19/10/2021 | 1.943.614.233,79 | (71.484.124,17) |
| | | | | | **6.106.438.803,33** | **(130.605.778,04)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| (328) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 51.291.695,65 | 319.221,18 |
| (458) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 90.140.301,65 | 1.507.414,93 |
| (530) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 124.900.271,20 | 4.108.105,51 |
| (44) | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 7.424.823,85 | 234.383,67 |
| 18 | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 2.865.937,50 | (53.156,25) |
| (1.628) | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 311.049.750,00 | 8.662.310,58 |
| (211) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 27.769.578,13 | 271.992,19 |
| 3.637 | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 446.413.337,76 | (2.159.466,93) |
| | | | **1.061.855.695,74** | **12.890.804,88** |
| | **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | **(75.781.911,51)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **6.513.680.257,04** | **92,60** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(75.781.911,51)** | **(1,08)** |
| **Bankguthaben** | **343.701.510,74** | **4,89** |
| **Bankverbindlichkeiten** | **(1.028.546,60)** | **(0,01)** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **253.402.041,97** | **3,60** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **7.033.973.351,64** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 512.289.311,69 |
| | 30.09.2020 | USD | 324.808.260,12 |
| | 30.09.2019 | USD | 221.165.202,66 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.587,77 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.469,93 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.597,50 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 19.350,94 |
| | 30.09.2020 | PLN | 19.117,05 |
| | 30.09.2019 | PLN | 19.886,45 |
| Capitalisation I Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.887,71 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.764,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.189,55 |
| Capitalisation N Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 258,47 |
| | 30.09.2020 | EUR | 252,87 |
| | 30.09.2019 | EUR | 271,23 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 272,22 |
| | 30.09.2020 | USD | 267,60 |
| | 30.09.2019 | USD | 274,84 |
| Capitalisation P Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 248,24 |
| | 30.09.2020 | EUR | 244,23 |
| | 30.09.2019 | EUR | 263,34 |
| Capitalisation R Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 249,98 |
| | 30.09.2020 | EUR | 245,22 |
| | 30.09.2019 | EUR | 263,95 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 206,55 |
| | 30.09.2020 | USD | 204,06 |
| | 30.09.2019 | USD | 210,75 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 4.922,12 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.000,77 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.894,05 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.693,90 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.121,91 |
| Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.104,30 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.954,10 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.273,19 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 3.575,48 |
| | 30.09.2020 | EUR | 3.630,94 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.224,77 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 614,86 |
| | 30.09.2020 | USD | 631,07 |
| | 30.09.2019 | USD | 681,94 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 2.411 |
| | 30.09.2020 | 2.918 |
| | 30.09.2019 | 1.742 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 2.757 |
| | 30.09.2020 | 4.268 |
| | 30.09.2019 | 5.517 |
| Capitalisation I Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 4.088 |
| | 30.09.2020 | 4.725 |
| | 30.09.2019 | 5.949 |
| Capitalisation N Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 26.636 |
| | 30.09.2020 | 25.372 |
| | 30.09.2019 | 20.738 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 263 |
| | 30.09.2020 | 328 |
| | 30.09.2019 | 458 |
| Capitalisation P Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 44 |
| | 30.09.2020 | 44 |
| | 30.09.2019 | 200 |
| Capitalisation R Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 38 |
| | 30.09.2020 | 38 |
| | 30.09.2019 | 132 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 16.582 |
| | 30.09.2020 | 19.953 |
| | 30.09.2019 | 22.757 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 1.631 |
| | 30.09.2019 | 1.631 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 75.856 |
| | 30.09.2020 | 39.980 |
| | 30.09.2019 | 18.528 |
| Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 1.536 |
| | 30.09.2020 | 1.634 |
| | 30.09.2019 | 2.498 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 1.603 |
| | 30.09.2020 | 1.527 |
| | 30.09.2019 | 1.469 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 25 |
| | 30.09.2020 | 25 |
| | 30.09.2019 | 25 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 180,45 |
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 28,75 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| **Laufende Kosten in %*** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation I Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation N Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 0,82% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,30% |
| Capitalisation P Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Capitalisation R Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 1,04% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 0,01% |
| Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 0,03% |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,30% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 79,77% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **496.002.726,66** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 481.803.290,04 |
| Geldmarktinstrumente | | 14.199.436,62 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **190.018,37** |
| Zinsswaps | | 190.018,37 |
| **Bankguthaben** | | **9.531.201,41** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **12.688.768,83** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***518.412.715,27*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(3.676.195,66)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(2.447.207,92)** |
| Devisentermingeschäfte | | (2.447.207,92) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(6.123.403,58)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***512.289.311,69*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **20.889.296,74** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 20.818.721,71 |
| Bankzinsen | | 3.927,94 |
| Zinsen auf Swaps | | 66.647,09 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(999.554,99)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (620.792,54) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (141.087,81) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (14.025,89) |
| Abonnementsteuer | 9 | (50.807,27) |
| Bankzinsen | | (21.035,73) |
| Zinsen auf Swaps | | (148.160,31) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (3.645,44) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **19.889.741,75** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 9.065.776,60 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (9.993.863,12) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 7.095.786,24 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (8.608.113,96) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 6.488.599,43 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (6.304.861,47) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (15.387.354,68) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (353.035,14) |
| **Ergebnis** | | **1.892.675,65** |
| Zeichnungen | | 240.979.431,87 |
| Rücknahmen | | (55.056.296,99) |
| Ausschüttung | | (334.758,96) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 324.808.260,12 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***512.289.311,69*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **China** | | | | |
| 79.000.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 1.990% 09/04/2025 | CNY | 11.945.399,03 | 2,32 |
| 12.800.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2.360% 02/07/2023 | CNY | 1.976.779,74 | 0,39 |
| 46.500.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2.680% 21/05/2030 | CNY | 7.023.825,02 | 1,37 |
| 20.000.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2.850% 04/06/2027 | CNY | 3.100.968,59 | 0,61 |
| 30.000.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2.940% 17/10/2024 | CNY | 4.690.772,68 | 0,92 |
| 27.000.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3.120% 05/12/2026 | CNY | 4.258.698,01 | 0,83 |
| 39.210.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3.190% 11/04/2024 | CNY | 6.169.719,70 | 1,20 |
| 12.000.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3.250% 22/11/2028 | CNY | 1.901.673,13 | 0,37 |
| 31.500.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3.290% 23/05/2029 | CNY | 5.009.890,12 | 0,98 |
| 27.000.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3.810% 14/09/2050 | CNY | 4.440.658,75 | 0,87 |
| | | | **50.518.384,77** | **9,86** |
| **Indonesien** | | | | |
| 64.000.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 5.500% 15/04/2026 | IDR | 4.521.200,22 | 0,88 |
| 123.220.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 6.125% 15/05/2028 | IDR | 8.792.380,17 | 1,71 |
| 73.000.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 6.500% 15/02/2031 | IDR | 5.151.771,61 | 1,01 |
| 30.900.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 6.500% 15/06/2025 | IDR | 2.269.548,99 | 0,44 |
| 1 | INDONESIA TREASURY BOND 7.000% 15/05/2022 | IDR | 0,00 | 0,00 |
| 1 | INDONESIA TREASURY BOND 7.000% 15/05/2027 | IDR | 0,00 | 0,00 |
| 90.000.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 7.000% 15/09/2030 | IDR | 6.637.689,24 | 1,30 |
| 35.000.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 7.500% 15/05/2038 | IDR | 2.562.596,24 | 0,50 |
| 56.500.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 7.500% 15/08/2032 | IDR | 4.220.790,41 | 0,82 |
| 19.000.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 8.250% 15/05/2029 | IDR | 1.500.640,32 | 0,29 |
| 28.610.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 8.250% 15/05/2036 | IDR | 2.253.119,57 | 0,44 |
| 67.738.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 8.375% 15/03/2034 | IDR | 5.407.465,55 | 1,06 |
| 13.470.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 8.750% 15/05/2031 | IDR | 1.102.452,18 | 0,22 |
| 36.019.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 9.000% 15/03/2029 | IDR | 2.959.761,25 | 0,58 |
| | | | **47.379.415,75** | **9,25** |
| **Mexiko** | | | | |
| 106.968.900 | MEXICAN BONOS 10.000% 05/12/2024 | MXN | 5.714.370,43 | 1,12 |
| 92.000.000 | MEXICAN BONOS 5.750% 05/03/2026 | MXN | 4.277.596,44 | 0,83 |
| 143.000.000 | MEXICAN BONOS 6.500% 09/06/2022 | MXN | 7.007.134,13 | 1,37 |
| 89.400.000 | MEXICAN BONOS 6.750% 09/03/2023 | MXN | 4.405.574,43 | 0,86 |
| 88.200.000 | MEXICAN BONOS 7.500% 03/06/2027 | MXN | 4.372.998,93 | 0,85 |
| 61.688.600 | MEXICAN BONOS 7.750% 13/11/2042 | MXN | 2.975.066,17 | 0,58 |
| 76.004.800 | MEXICAN BONOS 7.750% 29/05/2031 | MXN | 3.796.596,05 | 0,74 |
| 47.200.000 | MEXICAN BONOS 8.000% 07/11/2047 | MXN | 2.320.015,97 | 0,45 |
| 107.245.200 | MEXICAN BONOS 8.500% 18/11/2038 | MXN | 5.560.092,72 | 1,09 |
| 111.620.000 | MEXICAN BONOS 8.500% 31/05/2029 | MXN | 5.821.340,09 | 1,14 |
| | | | **46.250.785,36** | **9,03** |
| **Russland** | | | | |
| 106.648.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 6.500% 28/02/2024 | RUB | 1.445.066,33 | 0,28 |
| 348.223.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.000% 16/08/2023 | RUB | 4.775.502,90 | 0,93 |
| 433.700.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.050% 19/01/2028 | RUB | 5.933.005,87 | 1,16 |
| 139.295.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.250% 10/05/2034 | RUB | 1.895.970,63 | 0,37 |
| 48.000.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.400% 07/12/2022 | RUB | 661.957,14 | 0,13 |
| 142.631.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.400% 17/07/2024 | RUB | 1.970.791,42 | 0,38 |
| 930.000.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.650% 10/04/2030 | RUB | 13.174.186,30 | 2,57 |
| 96.000.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.700% 16/03/2039 | RUB | 1.360.076,67 | 0,27 |
| 195.450.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.750% 16/09/2026 | RUB | 2.747.728,82 | 0,54 |
| 140.460.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.950% 07/10/2026 | RUB | 1.994.428,99 | 0,39 |
| 360.540.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 8.150% 03/02/2027 | RUB | 5.173.932,82 | 1,01 |
| 286.510.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 8.500% 17/09/2031 | RUB | 4.298.986,17 | 0,84 |
| | | | **45.431.634,06** | **8,87** |
| **Südafrika** | | | | |
| 122.200.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 10.500% 21/12/2026 | ZAR | 9.118.343,32 | 1,78 |
| 64.200.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 7.000% 28/02/2031 | ZAR | 3.591.125,51 | 0,70 |
| 83.400.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.000% 31/01/2030 | ZAR | 5.150.254,22 | 1,01 |
| 88.960.677 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.250% 31/03/2032 | ZAR | 5.286.684,39 | 1,03 |
| 82.700.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.500% 31/01/2037 | ZAR | 4.604.859,90 | 0,90 |
| 38.686.683 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.750% 28/02/2048 | ZAR | 2.117.496,63 | 0,41 |
| 130.000.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 8.750% 31/01/2044 | ZAR | 7.129.109,01 | 1,39 |
| 80.430.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT BOND 9.000% 31/01/2040 | ZAR | 4.573.314,70 | 0,89 |
| | | | **41.571.187,68** | **8,11** |
| **Brasilien** | | | | |
| 27.300.000 | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL ZCP 01/07/2022* | BRL | 4.712.942,26 | 0,92 |
| 74.400.000 | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL ZCP 01/07/2023* | BRL | 11.601.378,69 | 2,27 |
| 33.600.000 | BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 10.000% 01/01/2023* | BRL | 6.369.488,41 | 1,24 |
| 41.000.000 | BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 10.000% 01/01/2025* | BRL | 7.673.113,54 | 1,50 |
| 36.000.000 | BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 10.000% 01/01/2027* | BRL | 6.613.779,95 | 1,29 |
| 20.000.000 | BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 10.000% 01/01/2029* | BRL | 3.604.397,81 | 0,70 |
| 3.200.000 | BRAZIL NOTAS DO TESOURO NACIONAL SERIE F 10.000% 01/01/2031 | BRL | 567.278,39 | 0,11 |
| | | | **41.142.379,05** | **8,03** |
| **Malaysia** | | | | |
| 9.300.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.478% 14/06/2024 | MYR | 2.280.608,82 | 0,45 |
| 11.500.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.502% 31/05/2027 | MYR | 2.798.672,22 | 0,55 |
| 14.000.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.733% 15/06/2028 | MYR | 3.436.450,53 | 0,67 |
| 5.600.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.800% 17/08/2023 | MYR | 1.380.627,25 | 0,27 |
| 10.800.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.828% 05/07/2034 | MYR | 2.555.828,53 | 0,50 |
| 9.100.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.885% 15/08/2029 | MYR | 2.249.838,16 | 0,44 |
| 7.423.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.900% 30/11/2026 | MYR | 1.855.764,84 | 0,36 |
| 5.390.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 4.065% 15/06/2050 | MYR | 1.248.396,92 | 0,24 |
| 14.365.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 4.181% 15/07/2024 | MYR | 3.583.691,57 | 0,70 |
| 8.979.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 4.232% 30/06/2031 | MYR | 2.281.916,99 | 0,45 |
| 3.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 4.392% 15/04/2026 | MYR | 762,63 | 0,00 |
| 7.666.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 4.762% 07/04/2037 | MYR | 1.994.791,16 | 0,39 |
| 17.400.000 | MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 3.726% 31/03/2026 | MYR | 4.284.111,50 | 0,83 |
| 17.370.000 | MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 4.094% 30/11/2023 | MYR | 4.326.576,82 | 0,84 |
| 11.400.000 | MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 4.258% 26/07/2027 | MYR | 2.874.217,50 | 0,56 |

* Anleihe/Swap mit „Dirty"-Bewertung (einschließlich Zinsen).

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 10.840.000 | MALAYSIA GOVERNMENT INVESTMENT ISSUE 4.467% 15/09/2039 | MYR | 2.651.962,64 | 0,52 |
| | | | **39.804.218,08** | **7,77** |
| | **Thailand** | | | |
| 8.766.109 | THAILAND GOVERNMENT BOND 1.250% 12/03/2028 | THB | 255.626,48 | 0,05 |
| 44.311.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 1.585% 17/12/2035 | THB | 1.196.983,55 | 0,23 |
| 157.000.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 2.000% 17/12/2031 | THB | 4.692.085,90 | 0,92 |
| 37.000.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 2.125% 17/12/2026 | THB | 1.153.171,23 | 0,23 |
| 22.189.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 2.400% 17/12/2023 | THB | 682.063,79 | 0,13 |
| 39.800.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 2.875% 17/06/2046 | THB | 1.231.487,27 | 0,24 |
| 75.000.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 2.875% 17/12/2028 | THB | 2.419.041,02 | 0,47 |
| 89.150.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 3.300% 17/06/2038 | THB | 2.929.416,91 | 0,57 |
| 74.164.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 3.400% 17/06/2036 | THB | 2.479.915,78 | 0,48 |
| 113.284.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 3.650% 20/06/2031 | THB | 3.874.091,19 | 0,76 |
| 131.824.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 3.775% 25/06/2032 | THB | 4.594.064,88 | 0,90 |
| 27.855.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 4.675% 29/06/2044 | THB | 1.112.447,68 | 0,22 |
| 57.960.000 | THAILAND GOVERNMENT BOND 4.875% 22/06/2029 | THB | 2.122.643,27 | 0,41 |
| | | | **28.743.038,95** | **5,61** |
| | **Polen** | | | |
| 6.200.000 | POLAND GOVERNMENT BOND 0.250% 25/10/2026 | PLN | 1.462.375,85 | 0,29 |
| 7.800.000 | POLAND GOVERNMENT BOND 1.250% 25/10/2030 | PLN | 1.835.113,27 | 0,36 |
| 37.200.000 | POLAND GOVERNMENT BOND 2.500% 25/01/2023 | PLN | 9.625.347,52 | 1,87 |
| 14.400.000 | POLAND GOVERNMENT BOND 2.750% 25/04/2028 | PLN | 3.862.332,66 | 0,75 |
| 20.300.000 | POLAND GOVERNMENT BOND 2.750% 25/10/2029 | PLN | 5.415.945,28 | 1,06 |
| 12.700.000 | POLAND GOVERNMENT BOND 5.750% 23/09/2022 | PLN | 3.373.960,81 | 0,66 |
| | | | **25.575.075,39** | **4,99** |
| | **Kolumbien** | | | |
| 3.000.000.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.375% 21/03/2023 | COP | 801.605,51 | 0,16 |
| 344.000.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.850% 28/06/2027 | COP | 106.028,06 | 0,02 |
| 15.825.800.000 | COLOMBIAN TES 10.000% 24/07/2024 | COP | 4.635.990,45 | 0,90 |
| 9.088.300.000 | COLOMBIAN TES 6.000% 28/04/2028 | COP | 2.244.559,29 | 0,44 |
| 10.419.800.000 | COLOMBIAN TES 7.000% 30/06/2032 | COP | 2.586.738,00 | 0,50 |
| 13.600.000.000 | COLOMBIAN TES 7.250% 18/10/2034 | COP | 3.385.353,40 | 0,66 |
| 3.300.000.000 | COLOMBIAN TES 7.250% 26/10/2050 | COP | 768.800,94 | 0,15 |
| 23.000.000.000 | COLOMBIAN TES 7.500% 26/08/2026 | COP | 6.252.355,23 | 1,23 |
| 8.600.000.000 | COLOMBIAN TES 7.750% 18/09/2030 | COP | 2.303.449,13 | 0,45 |
| | | | **23.084.880,01** | **4,51** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 99.130.000 | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 0.450% 25/10/2023 | CZK | 4.400.203,87 | 0,86 |
| 103.500.000 | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 0.950% 15/05/2030 | CZK | 4.315.452,64 | 0,84 |
| 150.000.000 | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 1.000% 26/06/2026 | CZK | 6.525.792,01 | 1,27 |
| 64.500.000 | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 2.000% 13/10/2033 | CZK | 2.908.806,50 | 0,57 |
| 63.360.000 | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 2.500% 25/08/2028 | CZK | 2.974.612,31 | 0,58 |
| 22.000.000 | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 4.200% 04/12/2036 | CZK | 1.267.868,84 | 0,25 |
| | | | **22.392.736,17** | **4,37** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Ungarn** | | | |
| 1.690.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 1.000% 26/11/2025 | HUF | 5.141.199,23 | 1,01 |
| 270.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 2.250% 20/04/2033 | HUF | 785.121,08 | 0,15 |
| 535.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 3.000% 21/08/2030 | HUF | 1.717.146,03 | 0,34 |
| 840.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 3.000% 27/10/2027 | HUF | 2.733.812,84 | 0,54 |
| 245.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 3.000% 27/10/2038 | HUF | 722.129,88 | 0,14 |
| 510.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 3.250% 22/10/2031 | HUF | 1.656.637,61 | 0,32 |
| 600.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 6.000% 24/11/2023 | HUF | 2.111.318,12 | 0,41 |
| 530.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 6.750% 22/10/2028 | HUF | 2.125.515,31 | 0,41 |
| 600.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 7.000% 24/06/2022 | HUF | 2.014.727,28 | 0,39 |
| | | | **19.007.607,38** | **3,71** |
| | **Rumänien** | | | |
| 4.830.000 | ROMANIA GOVERNMENT BOND 3.650% 24/09/2031 | RON | 1.063.763,09 | 0,21 |
| 7.500.000 | ROMANIA GOVERNMENT BOND 4.750% 24/02/2025 | RON | 1.827.549,25 | 0,36 |
| 9.510.000 | ROMANIA GOVERNMENT BOND 5.000% 12/02/2029 | RON | 2.342.527,24 | 0,46 |
| 15.200.000 | ROMANIA GOVERNMENT BOND 5.800% 26/07/2027 | RON | 3.903.418,26 | 0,76 |
| 24.830.000 | ROMANIA GOVERNMENT BOND 5.850% 26/04/2023 | RON | 6.074.963,14 | 1,18 |
| | | | **15.212.220,98** | **2,97** |
| | **Chile** | | | |
| 2.860.000.000 | BONOS DE LA TESORERIA DE LA REPUBLICA EN PESOS 4.500% 01/03/2026* | CLP | 3.444.423,71 | 0,67 |
| 2.985.000.000 | BONOS DE LA TESORERIA DE LA REPUBLICA EN PESOS 4.700% 01/09/2030* | CLP | 3.464.942,50 | 0,68 |
| 1.405.000.000 | BONOS DE LA TESORERIA DE LA REPUBLICA EN PESOS 5.000% 01/03/2035* | CLP | 1.611.027,46 | 0,31 |
| 760.000.000 | BONOS DE LA TESORERIA DE LA REPUBLICA EN PESOS 6.000% 01/01/2043* | CLP | 966.796,36 | 0,19 |
| 580.000.000 | BONOS TESORERIA 4.000% 01/03/2023* | CLP | 712.681,61 | 0,14 |
| | | | **10.199.871,64** | **1,99** |
| | **Türkei** | | | |
| 10.860.000 | TURKEY GOVERNMENT BOND 10.500% 11/08/2027 | TRY | 900.440,36 | 0,18 |
| 8.100.000 | TURKEY GOVERNMENT BOND 10.600% 11/02/2026 | TRY | 713.746,46 | 0,14 |
| 27.200.000 | TURKEY GOVERNMENT BOND 11.000% 02/03/2022 | TRY | 2.982.347,12 | 0,58 |
| 11.000.000 | TURKEY GOVERNMENT BOND 12.600% 01/10/2025 | TRY | 1.054.589,34 | 0,21 |
| 41.700.000 | TURKEY GOVERNMENT BOND 8.000% 12/03/2025 | TRY | 3.530.146,48 | 0,68 |
| | | | **9.181.269,76** | **1,79** |
| | **Peru** | | | |
| 4.370.000 | ALICORP SAA 6.875% 17/04/2027 | PEN | 1.045.500,16 | 0,20 |
| 12.200.000 | PERU GOVERNMENT BOND 5.940% 12/02/2029 | PEN | 2.961.051,74 | 0,58 |
| 12.160.000 | PERU GOVERNMENT BOND 6.150% 12/08/2032 | PEN | 2.814.546,20 | 0,55 |
| 5.748.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.950% 12/08/2031 | PEN | 1.440.650,94 | 0,28 |
| | | | **8.261.749,04** | **1,61** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 28.000.000.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 5.750% 24/01/2025 | IDR | 2.006.364,28 | 0,40 |
| | | | **2.006.364,28** | **0,40** |
| | **Republik Serbien** | | | |
| 80.000.000 | SERBIA TREASURY BONDS 4.500% 11/01/2026 | RSD | 847.934,00 | 0,17 |
| 68.000.000 | SERBIA TREASURY BONDS 4.500% 20/08/2032 | RSD | 723.468,52 | 0,14 |

* Anleihe/Swap mit „Dirty"-Bewertung (einschließlich Zinsen).

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.000.000 | SERBIA TREASURY BONDS 5.875% 08/02/2028 | RSD | 11.668,41 | 0,00 |
| | | | **1.583.070,93** | **0,31** |
| | **Südkorea** | | | |
| 14.000.000.000 | EXPORT-IMPORT BANK OF KOREA 7.250% 07/12/2024 | IDR | 1.034.182,55 | 0,20 |
| | | | **1.034.182,55** | **0,20** |
| | **Philippinen** | | | |
| 11.000.000 | PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.900% 26/11/2022 | PHP | 216.688,91 | 0,04 |
| 20.000.000 | PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 14/01/2036 | PHP | 466.012,47 | 0,09 |
| | | | **682.701,38** | **0,13** |
| | **Dominikanische Republik** | | | |
| 23.350.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 8.900% 15/02/2023 | DOP | 443.454,00 | 0,09 |
| 10.000.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 9.750% 05/06/2026 | DOP | 214.206,21 | 0,04 |
| | | | **657.660,21** | **0,13** |
| | **Uruguay** | | | |
| 8.000.000 | URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 21/05/2031 | UYU | 189.281,71 | 0,04 |
| 19.000.000 | URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.500% 15/03/2028 | UYU | 462.731,84 | 0,09 |
| | | | **652.013,55** | **0,13** |
| | | | **480.372.446,97** | **93,77** |
| | **Geldmarktinstrumente** | | | |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 8.000.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 04/11/2021 | USD | 7.999.460,80 | 1,56 |
| 6.200.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 07/10/2021 | USD | 6.199.975,82 | 1,21 |
| | | | **14.199.436,62** | **2,77** |
| | | | **14.199.436,62** | **2,77** |
| | **Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | |
| | **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | |
| | **Peru** | | | |
| 700.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.350% 12/08/2028 | PEN | 174.550,99 | 0,03 |
| 5.428.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.900% 12/08/2037 | PEN | 1.256.292,08 | 0,25 |
| | | | **1.430.843,07** | **0,28** |
| | | | **1.430.843,07** | **0,28** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **496.002.726,66** | **96,82** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in USD |
|---|---|---|---|---|---|
| | | **Zinsswaps** | | | |
| Floating | 1.595 | 23/07/2031 | KRW | 9.150.000.000,00 | 226.902,46 |
| Floating | 1.485 | 29/06/2031 | THB | 164.000.000,00 | 97.394,48 |
| 1.013 | Floating | 12/05/2026 | THB | 160.000.000,00 | (5.652,23) |
| 0.955 | Floating | 29/06/2026 | THB | 156.000.000,00 | (22.619,56) |
| 1.500 | Floating | 23/07/2026 | KRW | 8.780.000.000,00 | (106.006,78) |
| | | | | | **190.018,37** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | **Devisentermingeschäfte** | | | |
| 7.884.348,52 | USD | 2.320.000.000,00 | HUF | 18/11/2021 | 7.884.348,52 | 411.949,52 |
| 5.405.813,64 | USD | 4.103.000.000,00 | CLP | 20/10/2021 | 5.405.813,64 | 362.645,39 |
| 11.556.858,97 | USD | 173.000.000,00 | ZAR | 18/11/2021 | 11.556.858,97 | 131.004,84 |
| 3.360.462,41 | USD | 13.200.000,00 | PLN | 18/11/2021 | 3.360.462,41 | 37.024,70 |
| 1.116.817,18 | USD | 5.900.000,00 | BRL | 19/10/2021 | 1.116.817,18 | 36.754,91 |
| 30.400.000,00 | CNY | 4.654.209,60 | USD | 19/11/2021 | 4.654.209,60 | 36.569,32 |
| 858.093,03 | USD | 3.600.000,00 | RON | 07/10/2021 | 858.093,03 | 15.276,45 |
| 311.523,93 | USD | 4.500.000,00 | ZAR | 10/12/2021 | 311.523,93 | 15.260,02 |
| 357.790,05 | USD | 5.200.000,00 | ZAR | 08/11/2021 | 357.790,05 | 13.851,96 |
| 196.600.000,00 | INR | 2.634.589,88 | USD | 14/10/2021 | 2.634.589,88 | 12.558,90 |
| 393.237,17 | USD | 12.900.000,00 | THB | 18/10/2021 | 393.237,17 | 12.018,91 |
| 688.529,58 | USD | 2.800.000,00 | PEN | 19/10/2021 | 688.529,58 | 11.545,52 |
| 398.007,52 | USD | 8.000.000,00 | MXN | 08/11/2021 | 398.007,52 | 10.721,01 |
| 718.757,67 | USD | 2.814.602,66 | PLN | 19/10/2021 | 718.757,67 | 10.028,79 |
| 895.036,52 | USD | 768.945,04 | EUR | 19/10/2021 | 895.036,52 | 3.604,22 |
| 6.500.000,00 | CNY | 1.000.446,35 | USD | 30/11/2021 | 1.000.446,35 | 1.495,88 |
| 1.626.545,22 | USD | 10.500.000,00 | CNH | 12/10/2021 | 1.626.545,22 | 670,21 |
| 258,22 | EUR | 301,43 | USD | 01/10/2021 | 301,43 | (2,17) |
| 1.549,86 | EUR | 1.800,24 | USD | 04/10/2021 | 1.800,24 | (4,03) |
| 50.000.000,00 | RUB | 683.657,84 | USD | 03/11/2021 | 683.657,84 | (602,40) |
| 1.430.000,00 | TRY | 166.281,62 | USD | 18/10/2021 | 166.281,62 | (6.502,46) |
| 9.700.000,00 | CZK | 451.688,22 | USD | 18/10/2021 | 451.688,22 | (8.324,77) |
| 5.200.000,00 | ZAR | 359.222,55 | USD | 08/11/2021 | 359.222,55 | (15.284,46) |
| 22.500.000,00 | ZAR | 1.497.622,89 | USD | 10/12/2021 | 1.497.622,89 | (16.303,32) |
| 2.780.982,20 | USD | 10.800.000.000,00 | COP | 14/03/2022 | 2.780.982,20 | (16.993,87) |
| 3.600.000,00 | RON | 859.811,29 | USD | 07/10/2021 | 859.811,29 | (16.994,71) |
| 2.700.000,00 | PLN | 700.723,74 | USD | 16/12/2021 | 700.723,74 | (20.998,63) |
| 4.659.717,96 | USD | 30.400.000,00 | CNY | 19/11/2021 | 4.659.717,96 | (31.060,96) |
| 8.111.996,93 | USD | 597.200.000,00 | RUB | 03/11/2021 | 8.111.996,93 | (46.417,29) |
| 8.423.004,84 | USD | 55.000.000,00 | CNY | 30/11/2021 | 8.423.004,84 | (54.967,85) |
| 52.400.000,00 | MXN | 2.563.163,79 | USD | 14/03/2022 | 2.563.163,79 | (72.891,89) |
| 64.000.000,00 | MXN | 3.172.163,38 | USD | 08/11/2021 | 3.172.163,38 | (73.871,33) |
| 9.100.000.000,00 | KRW | 7.768.614,80 | USD | 30/11/2021 | 7.768.614,80 | (87.059,99) |
| 13.430.000,00 | PEN | 3.369.250,66 | USD | 19/10/2021 | 3.369.250,66 | (122.144,95) |
| 311.000.000,00 | THB | 9.318.835,10 | USD | 18/10/2021 | 9.318.835,10 | (128.224,41) |

* Anleihe/Swap mit „Dirty"-Bewertung (einschließlich Zinsen).

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 18.200.000,00 | BRL | 3.506.382,94 | USD | 19/10/2021 | 3.506.382,94 | (174.665,43) |
| 201.500.000,00 | THB | 6.165.519,06 | USD | 29/10/2021 | 6.165.519,06 | (211.268,39) |
| 2.320.000.000,00 | HUF | 7.765.240,17 | USD | 18/11/2021 | 7.765.240,17 | (292.841,14) |
| 67.270.000,00 | PLN | 17.377.007,58 | USD | 18/11/2021 | 17.377.007,58 | (440.064,02) |
| 173.000.000,00 | ZAR | 11.966.295,44 | USD | 18/11/2021 | 11.966.295,44 | (540.441,31) |
| 20.133.884,06 | EUR | 23.888.867,43 | USD | 19/10/2021 | 23.888.867,43 | (547.804,64) |
| 56.933.670,15 | PLN | 14.980.593,61 | USD | 19/10/2021 | 14.980.593,61 | (644.454,05) |
| | | | | | **184.399.812,95** | **(2.447.207,92)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(2.257.189,55)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **496.002.726,66** | **96,82** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(2.257.189,55)** | **(0,44)** |
| **Bankguthaben** | **9.531.201,41** | **1,86** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **9.012.573,17** | **1,76** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **512.289.311,69** | **100,00** |

* Anleihe/Swap mit „Dirty“-Bewertung (einschließlich Zinsen).

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 44.449.058,08 |
| | 30.09.2020 | USD | 52.790.927,05 |
| | 30.09.2019 | USD | 101.420.548,96 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 57,76 |
| | 30.09.2020 | USD | 56,18 |
| | 30.09.2019 | USD | 56,69 |
| Capitalisation I Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 44,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 43,12 |
| | 30.09.2019 | EUR | 45,06 |
| Capitalisation N (USD) | 30.09.2021 | USD | 55,81 |
| | 30.09.2020 | USD | 54,24 |
| | 30.09.2019 | USD | 54,69 |
| Capitalisation N Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 41,68 |
| | 30.09.2020 | EUR | 40,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 42,46 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 53,66 |
| | 30.09.2020 | USD | 52,41 |
| | 30.09.2019 | USD | 53,11 |
| Capitalisation P Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | SGD | 9,71 |
| | 30.09.2020 | SGD | - |
| | 30.09.2019 | SGD | 8,48 |
| Capitalisation P Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 39,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | 39,25 |
| | 30.09.2019 | EUR | 41,16 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 54,27 |
| | 30.09.2020 | USD | 52,86 |
| | 30.09.2019 | USD | 53,42 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 48,33 |
| | 30.09.2020 | USD | 47,44 |
| | 30.09.2019 | USD | 48,32 |
| Capitalisation X Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 209,40 |
| | 30.09.2020 | EUR | 206,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 217,77 |
| Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.055,85 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.902,43 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.077,89 |
| Distribution N (USD) | 30.09.2021 | USD | 30,78 |
| | 30.09.2020 | USD | 30,96 |
| | 30.09.2019 | USD | 32,67 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 30,73 |
| | 30.09.2020 | USD | 30,92 |
| | 30.09.2019 | USD | 32,59 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 30,75 |
| | 30.09.2020 | USD | 30,95 |
| | 30.09.2019 | USD | 32,63 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 67,69 |
| | 30.09.2020 | USD | 68,33 |
| | 30.09.2019 | USD | 72,19 |
| Distribution Z Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 3.712,99 |
| | 30.09.2020 | EUR | 3.753,69 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.066,57 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 209.466 |
| | 30.09.2020 | 223.366 |
| | 30.09.2019 | 505.267 |
| Capitalisation I Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 20.970 |
| | 30.09.2020 | 59.491 |
| | 30.09.2019 | 328.495 |
| Capitalisation N (USD) | 30.09.2021 | 1.647 |
| | 30.09.2020 | 1.683 |
| | 30.09.2019 | 3.032 |
| Capitalisation N Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 6.065 |
| | 30.09.2020 | 8.132 |
| | 30.09.2019 | 8.228 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 69.680 |
| | 30.09.2020 | 83.626 |
| | 30.09.2019 | 102.844 |
| Capitalisation P Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | 895 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 226 |
| Capitalisation P Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 112.969 |
| | 30.09.2020 | 161.038 |
| | 30.09.2019 | 315.139 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 10.202 |
| | 30.09.2020 | 12.820 |
| | 30.09.2019 | 17.479 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 89.309 |
| | 30.09.2020 | 115.909 |
| | 30.09.2019 | 164.183 |
| Capitalisation X Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 2.024 |
| | 30.09.2020 | 3.957 |
| | 30.09.2019 | 3.518 |
| Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 1.586 |
| | 30.09.2020 | 1.691 |
| | 30.09.2019 | 2.486 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution N (USD) | 30.09.2021 | 8.392 |
| | 30.09.2020 | 8.884 |
| | 30.09.2019 | 9.683 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 7.168 |
| | 30.09.2020 | 8.278 |
| | 30.09.2019 | 9.335 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 15.036 |
| | 30.09.2020 | 15.186 |
| | 30.09.2019 | 30.870 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 4.300 |
| | 30.09.2020 | 6.065 |
| | 30.09.2019 | 11.441 |
| Distribution Z Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 1.401 |
| | 30.09.2020 | 1.519 |
| | 30.09.2019 | 2.385 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution N (USD) | 14.12.2020 | USD | 1,10 |
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 0,95 |
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 1,05 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,11 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,11 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,11 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,15 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,15 |
| Distribution X (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 0,15 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,18 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,18 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,18 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,21 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,21 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,21 |
| Distribution Z Hedged (iv) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 158,55 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,89% |
| Capitalisation I Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Capitalisation N (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation N Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,31% |
| Capitalisation P Hedged (i) (SGD) | 30.09.2021 | 1,33% |
| Capitalisation P Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 1,33% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,03% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,81% |
| Capitalisation X Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Capitalisation Zz Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 0,04% |
| Distribution N (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,31% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,03% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 1,81% |
| Distribution Z Hedged (iv) (EUR) | 30.09.2021 | 0,12% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 91,95% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **33.188.281,59** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 3.833.232,25 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 21.255.509,39 |
| Geldmarktinstrumente | | 8.099.539,95 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **48.866,53** |
| Zinsswaps | | 48.866,53 |
| **Bankguthaben** | | **13.581.219,43** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **11.699.046,01** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***58.517.413,56*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(13.386.424,74)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(681.930,74)** |
| Credit Default Swaps | | (7.185,52) |
| Devisentermingeschäfte | | (674.745,22) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(14.068.355,48)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***44.449.058,08*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **2.564.454,12** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 2.550.982,44 |
| Bankzinsen | | 8.320,62 |
| Zinsen auf Swaps | | 5.151,06 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(471.320,21)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (315.320,87) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (74.716,14) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (5.681,86) |
| Abonnementsteuer | 9 | (11.106,20) |
| Bankzinsen | | (1.347,39) |
| Zinsen auf Swaps | | (63.147,75) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **2.093.133,91** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 2.931.582,54 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (3.482.865,24) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 4.782.791,76 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (3.533.384,41) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 718.467,76 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (710.182,44) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (1.290.926,75) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (421.733,51) |
| **Ergebnis** | | **1.086.883,62** |
| Zeichnungen | | 7.276.100,38 |
| Rücknahmen | | (16.370.834,29) |
| Ausschüttung | | (334.018,68) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 52.790.927,05 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***44.449.058,08*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Singapur** | | | |
| 4.000.000 | SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.250% 01/10/2021 | SGD | 2.946.375,96 | 6,63 |
| 2.690.000 | SINGAPORE GOVERNMENT BOND 1.750% 01/04/2022 | SGD | 1.994.939,29 | 4,49 |
| | | | **4.941.315,25** | **11,12** |
| | **Mexiko** | | | |
| 28.000.000 | MEXICAN BONOS 6.500% 09/06/2022 | MXN | 1.372.026,26 | 3,09 |
| 53.800.000 | MEXICAN BONOS 7.250% 09/12/2021 | MXN | 2.629.213,06 | 5,91 |
| | | | **4.001.239,32** | **9,00** |
| | **Südkorea** | | | |
| 3.400.000.000 | KOREA TREASURY BOND 1.250% 10/12/2022 | KRW | 2.881.756,21 | 6,48 |
| | | | **2.881.756,21** | **6,48** |
| | **Brasilien** | | | |
| 4.800.000 | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL ZCP 01/01/2022 | BRL | 865.894,68 | 1,95 |
| 5.000.000 | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL ZCP 01/04/2022 | BRL | 883.017,45 | 1,99 |
| 4.800.000 | BRAZIL LETRAS DO TESOURO NACIONAL ZCP 01/10/2021 | BRL | 880.681,09 | 1,98 |
| | | | **2.629.593,22** | **5,92** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 35.000.000 | CZECH REPUBLIC GOVERNMENT BOND 0.100% 17/04/2022 | CZK | 1.588.374,43 | 3,58 |
| | | | **1.588.374,43** | **3,58** |
| | **Rumänien** | | | |
| 1.920.000 | ROMANIA GOVERNMENT BOND 3.400% 08/03/2022 | RON | 451.403,21 | 1,02 |
| 1.350.000 | ROMANIA GOVERNMENT BOND 4.000% 27/10/2021 | RON | 316.510,26 | 0,71 |
| | | | **767.913,47** | **1,73** |
| | **Israel** | | | |
| 390.000 | ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 1.250% 30/11/2022 | ILS | 123.800,51 | 0,28 |
| 1.800.000 | ISRAEL GOVERNMENT BOND - FIXED 5.500% 31/01/2022 | ILS | 588.627,31 | 1,32 |
| | | | **712.427,82** | **1,60** |
| | **Russland** | | | |
| 48.000.000 | RUSSIAN FEDERAL BOND - OFZ 7.650% 10/04/2030 | RUB | 679.958,00 | 1,53 |
| | | | **679.958,00** | **1,53** |
| | **Ungarn** | | | |
| 201.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT BOND 2.500% 27/10/2021 | HUF | 649.031,47 | 1,46 |
| | | | **649.031,47** | **1,46** |
| | **Indonesien** | | | |
| 5.000.000.000 | INDONESIA TREASURY BOND 6.125% 15/05/2028 | IDR | 356.775,69 | 0,80 |
| | | | **356.775,69** | **0,80** |
| | **China** | | | |
| 100.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3.190% 11/04/2024 | CNY | 15.735,07 | 0,04 |
| | | | **15.735,07** | **0,04** |
| | | | **19.224.119,95** | **43,26** |
| **Geldmarktinstrumente** | | | | |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 2.800.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 04/11/2021 | USD | 2.799.811,28 | 6,30 |
| 2.500.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 12/11/2021 | USD | 2.499.860,30 | 5,62 |
| 2.800.000 | UNITED STATES TREASURY BILL ZCP 28/10/2021 | USD | 2.799.868,37 | 6,30 |
| | | | **8.099.539,95** | **18,22** |
| | | | **8.099.539,95** | **18,22** |
| **Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Malaysia** | | | |
| 8.480.000 | MALAYSIA GOVERNMENT BOND 3.620% 30/11/2021 | MYR | 2.031.389,44 | 4,57 |
| | | | **2.031.389,44** | **4,57** |
| | | | **2.031.389,44** | **4,57** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 693 | NN (L) EMERGING MARKETS DEBT SHORT DURATION (HARD CURRENCY) - Z CAP USD | USD | 3.833.232,25 | 8,62 |
| | | | **3.833.232,25** | **8,62** |
| | | | **3.833.232,25** | **8,62** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **33.188.281,59** | **74,67** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeich-nung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeits-datum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swaps** | | | | | | |
| CDS REPUBLIC OF SOUTH AFRICA 1.000% 20/06/2025 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 620.000,00 | 33.490,78 |
| CDS REPUBLIC OF PERU 1.000% 20/12/2022 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 590.000,00 | 1.800,19 |
| CDS REPUBLIC OF CHILE 1.000% 20/06/2025 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 580.000,00 | (3.748,68) |
| CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 570.000,00 | (15.542,90) |
| CDS REPUBLIC OF KOREA 1.000% 20/06/2024 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 560.000,00 | (23.184,91) |
| | | | | | | **(7.185,52)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeits-datum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in USD |
|---|---|---|---|---|---|
| **Zinsswaps** | | | | | |
| Floating | 1,345 | 17/06/2026 | PLN | 6.600.000,00 | 37.688,57 |
| Floating | 1,595 | 23/07/2031 | KRW | 850.000.000,00 | 21.078,37 |
| 1,500 | Floating | 23/07/2026 | KRW | 820.000.000,00 | (9.900,41) |
| | | | | | **48.866,53** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 243.200.000,00 | INR | 3.226.183,29 | USD | 14/10/2021 | 3.226.183,29 | 48.417,85 |
| 456.214,99 | USD | 345.300.000,00 | CLP | 20/10/2021 | 456.214,99 | 31.792,37 |
| 63.000.000,00 | RUB | 841.062,50 | USD | 13/10/2021 | 841.062,50 | 23.079,62 |
| 12.000.000,00 | CNY | 1.839.163,02 | USD | 18/10/2021 | 1.839.163,02 | 17.832,25 |
| 12.900.000,00 | CNY | 1.980.418,76 | USD | 12/10/2021 | 1.980.418,76 | 16.911,32 |
| 11.900.000.000,00 | IDR | 817.207,79 | USD | 15/11/2021 | 817.207,79 | 10.340,82 |
| 7.600.000,00 | CNY | 1.167.166,65 | USD | 04/11/2021 | 1.167.166,65 | 7.158,89 |
| 317.505,27 | USD | 268.265,16 | EUR | 19/10/2021 | 317.505,27 | 6.507,46 |
| 253.912,66 | USD | 3.800.000,00 | ZAR | 18/11/2021 | 253.912,66 | 2.940,14 |
| 107.000.000,00 | RUB | 1.446.135,51 | USD | 16/12/2021 | 1.446.135,51 | 2.903,88 |
| 6.300.000.000,00 | IDR | 436.609,80 | USD | 08/11/2021 | 436.609,80 | 1.869,17 |
| 40.176,78 | USD | 160.000,00 | PEN | 18/10/2021 | 40.176,78 | 1.491,28 |
| 24.977,99 | USD | 500.000,00 | MXN | 08/11/2021 | 24.977,99 | 772,58 |
| 25.798,65 | USD | 7.800.000,00 | HUF | 06/10/2021 | 25.798,65 | 635,10 |
| 25.729,16 | USD | 100.000,00 | PLN | 08/12/2021 | 25.729,16 | 553,99 |
| 17.659,82 | USD | 14.000.000,00 | CLP | 19/11/2021 | 17.659,82 | 500,48 |
| 23.797,16 | USD | 100.000,00 | RON | 04/10/2021 | 23.797,16 | 381,79 |
| 302.251,68 | USD | 410.000,00 | SGD | 01/10/2021 | 302.251,68 | 248,14 |
| 149.612,75 | USD | 11.100.000,00 | INR | 14/10/2021 | 149.612,75 | 155,22 |
| 23.684,96 | USD | 485.000,00 | MXN | 05/10/2021 | 23.684,96 | 82,44 |
| 98.816,26 | USD | 7.200.000,00 | RUB | 13/10/2021 | 98.816,26 | 55,81 |
| 69.320,28 | USD | 620.000,00 | TRY | 18/10/2021 | 69.320,28 | 45,40 |
| 97.669,60 | USD | 5.000.000,00 | PHP | 25/10/2021 | 97.669,60 | (6,97) |
| 64.912,02 | USD | 933.000.000,00 | IDR | 08/11/2021 | 64.912,02 | (24,63) |
| 8.738,38 | SGD | 6.501,32 | USD | 19/10/2021 | 6.501,32 | (64,88) |
| 92.775,15 | USD | 600.000,00 | CNY | 12/10/2021 | 92.775,15 | (123,92) |
| 100.000,00 | PEN | 24.397,98 | USD | 03/12/2021 | 24.397,98 | (252,72) |
| 220.933,59 | USD | 858.000.000,00 | COP | 14/03/2022 | 220.933,59 | (1.350,06) |
| 122.735,26 | USD | 400.000,00 | ILS | 12/01/2022 | 122.735,26 | (1.386,62) |
| 6.000.000,00 | PHP | 118.795,41 | USD | 03/12/2021 | 118.795,41 | (2.086,60) |
| 3.100.000,00 | CZK | 145.025,58 | USD | 07/12/2021 | 145.025,58 | (3.593,40) |
| 1.500.000.000,00 | COP | 396.639,67 | USD | 03/12/2021 | 396.639,67 | (4.844,39) |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 5.680.000,00 | MXN | 280.465,97 | USD | 08/11/2021 | 280.465,97 | (5.492,55) |
| 4.100.000,00 | MXN | 200.552,89 | USD | 14/03/2022 | 200.552,89 | (5.703,37) |
| 34.500.000,00 | TWD | 1.249.803,07 | USD | 03/12/2021 | 1.249.803,07 | (6.044,40) |
| 130.000.000,00 | CLP | 165.554,48 | USD | 19/11/2021 | 165.554,48 | (6.217,78) |
| 42.000.000,00 | INR | 569.118,80 | USD | 03/12/2021 | 569.118,80 | (6.707,93) |
| 1.104.904,55 | USD | 7.200.000,00 | CNY | 04/11/2021 | 1.104.904,55 | (7.614,38) |
| 39.500.000,00 | TWD | 1.428.623,30 | USD | 15/10/2021 | 1.428.623,30 | (8.912,36) |
| 905.000,00 | PEN | 228.997,98 | USD | 19/10/2021 | 228.997,98 | (10.187,06) |
| 8.200.000,00 | TRY | 926.911,03 | USD | 18/10/2021 | 926.911,03 | (10.694,86) |
| 28.000.000,00 | THB | 838.690,22 | USD | 18/10/2021 | 838.690,22 | (11.239,74) |
| 1.180.000,00 | BRL | 228.319,34 | USD | 19/10/2021 | 228.319,34 | (12.306,89) |
| 40.000.000,00 | PHP | 794.849,38 | USD | 25/10/2021 | 794.849,38 | (13.436,81) |
| 345.300.000,00 | CLP | 439.934,26 | USD | 20/10/2021 | 439.934,26 | (15.511,64) |
| 138.000.000,00 | HUF | 464.212,04 | USD | 06/10/2021 | 464.212,04 | (19.010,75) |
| 2.468.600.000,00 | KRW | 2.105.031,90 | USD | 30/11/2021 | 2.105.031,90 | (21.220,23) |
| 1.600.000,00 | PEN | 411.639,10 | USD | 18/10/2021 | 411.639,10 | (24.784,14) |
| 45.230.000,00 | THB | 1.375.640,90 | USD | 08/11/2021 | 1.375.640,90 | (39.195,19) |
| 8.700.000,00 | TRY | 1.006.347,60 | USD | 08/11/2021 | 1.006.347,60 | (45.228,51) |
| 15.800.000,00 | ZAR | 1.092.875,54 | USD | 18/11/2021 | 1.092.875,54 | (49.358,23) |
| 9.650.000,00 | PLN | 2.541.662,28 | USD | 08/12/2021 | 2.541.662,28 | (112.258,49) |
| 14.867.890,13 | EUR | 17.640.796,72 | USD | 19/10/2021 | 17.640.796,72 | (404.561,72) |
| | | | | | **49.968.722,66** | **(674.745,22)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(633.064,21)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **33.188.281,59** | **74,67** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(633.064,21)** | **(1,42)** |
| **Bankguthaben** | **13.581.219,43** | **30,55** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(1.687.378,73)** | **(3,80)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **44.449.058,08** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 102.935.994,80 |
| | 30.09.2020 | USD | 102.061.065,87 |
| | 30.09.2019 | USD | 122.619.134,20 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.435,84 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.359,65 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.207,37 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 246,63 |
| | 30.09.2020 | EUR | 246,71 |
| | 30.09.2019 | EUR | 246,19 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.530,41 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.425,72 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.246,27 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 62 |
| | 30.09.2020 | | 75 |
| | 30.09.2019 | | 60 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 9 |
| | 30.09.2020 | | 29 |
| | 30.09.2019 | | 29 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | | 18.551 |
| | 30.09.2020 | | 18.735 |
| | 30.09.2019 | | 23.312 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 0,66% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 1,25% |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | | 0,16% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 76,56% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **97.484.498,96** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 97.484.498,96 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **109.704,98** |
| Credit Default Swaps | | 89.814,38 |
| Futures | | 19.890,60 |
| **Bankguthaben** | | **4.437.126,22** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **23.201,59** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **9.047.958,04** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***111.102.489,79*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(8.166.432,55)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(62,44)** |
| Devisentermingeschäfte | | (62,44) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(8.166.494,99)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***102.935.994,80*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **4.378.654,98** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 4.271.200,13 |
| Bankzinsen | | 2.704,42 |
| Sonstige Erträge | 10 | 104.750,43 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(230.075,79)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.885,30) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (155.741,97) |
| Abonnementsteuer | 9 | (10.376,97) |
| Bankzinsen | | (147,89) |
| Zinsen auf Swaps | | (61.923,66) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **4.148.579,19** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 1.536.560,21 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.974.977,14) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 23.668,94 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (301.214,81) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 20,07 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (20,07) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (1.317.679,07) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (142.637,55) |
| **Ergebnis** | | **1.972.299,77** |
| Zeichnungen | | 2.359,98 |
| Rücknahmen | | (1.099.730,82) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 102.061.065,87 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***102.935.994,80*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 200.000 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC 2.625% 02/06/2026 | USD | 200.010,20 | 0,19 |
| 400.000 | ABQ FINANCE LTD 3.500% 22/02/2022 EMTN | USD | 403.511,08 | 0,39 |
| 750.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD 5.750% 02/01/2025 | USD | 705.919,94 | 0,69 |
| 200.000 | AMBER CIRCLE FUNDING LTD 3.250% 04/12/2022 | USD | 206.235,65 | 0,20 |
| 250.000 | CCBL CAYMAN 1 CORP LTD 1.990% 21/07/2025 EMTN | USD | 251.567,33 | 0,24 |
| 250.000 | CCBL CAYMAN 1 CORP LTD 3.500% 16/05/2024 EMTN | USD | 264.281,10 | 0,26 |
| 2.000.000 | CDBL FUNDING 1 3.000% 24/04/2023 EMTN | USD | 2.048.239,16 | 1,98 |
| 450.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.250% 13/08/2024 | USD | 274.500,00 | 0,27 |
| 200.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.650% 27/08/2023 | USD | 128.755,22 | 0,13 |
| 200.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.750% 24/05/2024 | USD | 122.871,63 | 0,12 |
| 600.000 | CHINA AOYUAN GROUP LTD 6.200% 24/03/2026 | USD | 461.285,17 | 0,45 |
| 200.000 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.250% 08/06/2024 | USD | 203.175,47 | 0,20 |
| 660.000 | CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN V LTD 3.950% 15/11/2022 | USD | 679.383,26 | 0,66 |
| 800.000 | CHINA OVERSEAS FINANCE CAYMAN VII LTD 4.250% 26/04/2023 | USD | 835.404,21 | 0,81 |
| 250.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.000% 02/05/2025 | USD | 236.241,78 | 0,23 |
| 300.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.250% 19/04/2023 | USD | 292.524,30 | 0,28 |
| 400.000 | CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD 6.450% 07/11/2024 | USD | 401.423,57 | 0,39 |
| 1.000.000 | DIB SUKUK LTD 1.500% 22/06/2026 | USD | 997.588,89 | 0,97 |
| 270.000 | DIB SUKUK LTD 3.625% 06/02/2023 | USD | 279.214,62 | 0,27 |
| 300.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 10.875% 09/01/2023 | USD | 96.100,33 | 0,09 |
| 200.000 | HPHT FINANCE 21 LTD 2.000% 19/03/2026 | USD | 202.186,75 | 0,20 |
| 500.000 | INDUSTRIAL SENIOR TRUST 5.500% 01/11/2022 | USD | 515.844,76 | 0,50 |
| 358.076 | INTEROCEANICA IV FINANCE LTD ZCP 30/11/2025 | USD | 330.106,65 | 0,32 |
| 200.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.650% 01/06/2026 | USD | 152.561,40 | 0,15 |
| 474.146 | PERU ENHANCED PASS-THROUGH FINANCE LTD ZCP 02/06/2025 | USD | 453.550,98 | 0,44 |
| 1.400.000 | QIB SUKUK LTD 3.982% 26/03/2024 EMTN | USD | 1.498.075,98 | 1,45 |
| 400.000 | QNB FINANCE LTD 3.500% 28/03/2024 EMTN | USD | 423.867,70 | 0,41 |
| 400.000 | RED SUN PROPERTIES GROUP LTD 7.300% 13/01/2025 | USD | 331.980,17 | 0,32 |
| 168.032 | SPARC EM SPC PANAMA METRO LINE 2 SP ZCP 05/12/2022 | USD | 165.831,25 | 0,16 |
| 250.000 | SUN HUNG KAI PROPERTIES CAPITAL MARKET LTD 3.625% 16/01/2023 EMTN | USD | 258.398,43 | 0,25 |
| 200.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD 6.650% 03/08/2024 | USD | 161.135,75 | 0,16 |
| 200.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 5.550% 04/06/2024 | USD | 185.403,34 | 0,18 |
| 600.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.200% 22/03/2026 | USD | 543.199,81 | 0,53 |
| 200.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.375% 30/10/2024 | USD | 154.175,59 | 0,15 |
| 200.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 8.500% 04/02/2023 | USD | 170.161,68 | 0,17 |
| 300.000 | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.100% 10/09/2024 | USD | 263.807,53 | 0,26 |
| | | | **14.898.520,68** | **14,47** |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 500.000 | ARCOS DORADOS HOLDINGS INC 6.625% 27/09/2023 | USD | 540.974,85 | 0,53 |
| 200.000 | BAIC FINANCE INVESTMENT CO LTD 2.000% 16/03/2024 | USD | 201.373,95 | 0,20 |
| 200.000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS LTD 3.375% 16/07/2024 | USD | 209.338,79 | 0,20 |
| 700.000 | CMHI FINANCE BVI CO LTD 4.375% 06/08/2023 | USD | 740.308,77 | 0,72 |
| 300.000 | CNPC GENERAL CAPITAL LTD 3.400% 16/04/2023 | USD | 311.460,50 | 0,30 |
| 200.000 | EASY TACTIC LTD 5.750% 13/01/2022 | USD | 180.441,08 | 0,18 |
| 200.000 | EASY TACTIC LTD 5.875% 13/02/2023 | USD | 145.152,25 | 0,14 |
| 200.000 | EASY TACTIC LTD 8.125% 27/02/2023 | USD | 145.385,15 | 0,14 |
| 250.000 | EASY TACTIC LTD 8.625% 27/02/2024 | USD | 164.963,42 | 0,16 |
| 200.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 5.000% 18/05/2026 | USD | 197.650,42 | 0,19 |
| 200.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 5.950% 19/10/2025 | USD | 203.949,80 | 0,20 |
| 300.000 | GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD 5.900% 12/02/2023 EMTN | USD | 222.179,60 | 0,22 |
| 200.000 | HONG SENG LTD 9.875% 27/08/2022 | USD | 190.938,21 | 0,19 |
| 200.000 | HORSE GALLOP FINANCE LTD 1.700% 28/07/2025 EMTN | USD | 198.922,84 | 0,19 |
| 700.000 | IS HONG KONG INVESTMENT LTD 2.900% 30/12/2022 | USD | 713.430,43 | 0,69 |
| 200.000 | LEVC FINANCE LTD 1.375% 25/03/2024 | USD | 200.258,41 | 0,19 |
| 850.000 | NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025 | USD | 784.419,60 | 0,76 |
| 200.000 | OCEAN LAUREL CO LTD 2.375% 20/10/2025 | USD | 197.470,28 | 0,19 |
| 400.000 | POLY REAL ESTATE FINANCE LTD 3.875% 25/03/2024 | USD | 417.244,36 | 0,41 |
| 200.000 | SHANGHAI PORT GROUP BVI DEVELOPMENT CO LTD 2.875% 18/06/2024 | USD | 208.975,69 | 0,20 |
| 1.000.000 | STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT BVI LTD 2.750% 04/05/2022 | USD | 1.012.095,85 | 0,98 |
| 610.000 | TALENT YIELD INVESTMENTS LTD 4.500% 25/04/2022 | USD | 621.991,58 | 0,60 |
| 3.400.000 | 1MDB GLOBAL INVESTMENTS LTD 4.400% 09/03/2023 | USD | 3.424.530,86 | 3,33 |
| | | | **11.233.456,69** | **10,91** |
| | **Vereinigte Arabische Emirate** | | | |
| 300.000 | ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.125% 30/09/2024 | USD | 311.343,32 | 0,30 |
| 1.275.000 | ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.500% 16/04/2025 | USD | 1.342.753,10 | 1,31 |
| 250.000 | ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 16/04/2050 EMTN | USD | 250.946,00 | 0,24 |
| 400.000 | ABU DHABI NATIONAL ENERGY CO PJSC 3.875% 06/05/2024 | USD | 430.687,88 | 0,42 |
| 355.000 | EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC 1.639% 15/06/2026 EMTN | USD | 356.588,38 | 0,35 |
| 900.000 | EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC 3.516% 06/03/2024 EMTN | USD | 958.148,62 | 0,93 |
| 1.000.000 | NBK SPC LTD 2.750% 30/05/2022 | USD | 1.012.485,25 | 0,98 |
| | | | **4.662.952,55** | **4,53** |
| | **Saudi-Arabien** | | | |
| 4.500.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 04/03/2023 EMTN | USD | 4.635.043,74 | 4,50 |
| | | | **4.635.043,74** | **4,50** |
| | **Türkei** | | | |
| 330.000 | ISTANBUL METROPOLITAN MUNICIPALITY 6.375% 09/12/2025 | USD | 325.329,75 | 0,32 |
| 300.000 | TURK IHRACAT KREDI BANKASI AS 5.750% 06/07/2026 | USD | 295.087,83 | 0,29 |
| 718.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 26/01/2026 | USD | 693.602,47 | 0,67 |
| 600.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 22/03/2024 | USD | 613.073,68 | 0,60 |
| 1.000.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.350% 10/08/2024 | USD | 1.034.924,40 | 1,00 |
| 740.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 14/10/2025 | USD | 759.207,58 | 0,73 |
| 200.000 | TURKIYE VAKIFLAR BANKASI TAO 5.750% 30/01/2023 EMTN | USD | 204.989,41 | 0,20 |
| 450.000 | YAPI VE KREDI BANKASI AS 6.100% 16/03/2023 | USD | 463.699,68 | 0,45 |
| | | | **4.389.914,80** | **4,26** |
| | **Mexiko** | | | |
| 200.000 | BBVA BANCOMER SA/TEXAS 6.750% 30/09/2022 | USD | 210.230,86 | 0,20 |
| 521.000 | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV 1.875% 11/05/2026 | USD | 521.836,19 | 0,51 |
| 1.250.000 | PETROLEOS MEXICANOS 11/03/2022 FRN | USD | 1.257.339,34 | 1,22 |
| 1.000.000 | PETROLEOS MEXICANOS 4.875% 18/01/2024 | USD | 1.038.267,97 | 1,01 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 400.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.875% 16/10/2025 | USD | 438.358,14 | 0,43 |
| 400.000 | TRUST FIBRA UNO 5.250% 15/12/2024 | USD | 441.675,60 | 0,43 |
| | | | **3.907.708,10** | **3,80** |
| | **Brasilien** | | | |
| 1.000.000 | BANCO BTG PACTUAL SA/CAYMAN ISLANDS 2.750% 11/01/2026 | USD | 972.953,96 | 0,95 |
| 400.000 | BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN 4.750% 20/03/2024 EMTN | USD | 425.614,13 | 0,41 |
| 595.000 | BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 06/06/2025 | USD | 608.156,14 | 0,59 |
| 500.000 | BRF SA 4.750% 22/05/2024 | USD | 527.271,79 | 0,51 |
| 400.000 | CENTRAIS ELETRICAS BRASILEIRAS SA 3.625% 04/02/2025 | USD | 399.283,66 | 0,39 |
| 500.000 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA/CAYMAN ISLAND 3.250% 24/01/2025 | USD | 507.086,29 | 0,49 |
| | | | **3.440.365,97** | **3,34** |
| | **Irland** | | | |
| 1.320.000 | CREDIT BANK OF MOSCOW 3.875% 21/09/2026 | USD | 1.304.167,72 | 1,27 |
| 750.000 | METALLOINVEST FINANCE DAC 4.850% 02/05/2024 | USD | 806.279,29 | 0,78 |
| 800.000 | SOVCOMBANK 3.400% 26/01/2025 | USD | 805.706,86 | 0,78 |
| | | | **2.916.153,87** | **2,83** |
| | **Katar** | | | |
| 1.000.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 14/03/2024 | USD | 1.063.353,15 | 1,03 |
| 1.550.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 23/04/2023 | USD | 1.630.628,09 | 1,59 |
| | | | **2.693.981,24** | **2,62** |
| | **Bermuda** | | | |
| 600.000 | BERMUDA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.138% 03/01/2023 | USD | 625.748,63 | 0,61 |
| 600.000 | BERMUDA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.854% 06/02/2024 | USD | 653.410,33 | 0,63 |
| 1.000.000 | CBQ FINANCE LTD 2.000% 12/05/2026 EMTN | USD | 1.005.279,56 | 0,98 |
| 200.000 | CHINA OIL & GAS GROUP LTD 4.700% 30/06/2026 | USD | 204.037,30 | 0,20 |
| 200.000 | CHINA OIL & GAS GROUP LTD 5.500% 25/01/2023 | USD | 204.190,63 | 0,20 |
| | | | **2.692.666,45** | **2,62** |
| | **Indonesien** | | | |
| 400.000 | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT 4.750% 13/05/2025 EMTN | USD | 443.282,48 | 0,43 |
| 200.000 | BANK NEGARA INDONESIA 3.750% 30/03/2026 EMTN | USD | 205.616,19 | 0,20 |
| 1.000.000 | PERTAMINA PERSERO PT 1.400% 09/02/2026 | USD | 983.151,80 | 0,96 |
| 1.000.000 | PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 1.500% 09/06/2026 | USD | 1.001.585,24 | 0,97 |
| | | | **2.633.635,71** | **2,56** |
| | **Pakistan** | | | |
| 750.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 08/04/2026 EMTN | USD | 746.305,82 | 0,73 |
| 900.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 15/04/2024 | USD | 961.601,97 | 0,92 |
| 750.000 | THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUKUK CO LTD/THE 5.625% 05/12/2022 | USD | 766.935,26 | 0,75 |
| | | | **2.474.843,05** | **2,40** |
| | **Dominikanische Republik** | | | |
| 1.350.000 | BANCO DE RESERVAS DE LA REPUBLICA DOMINICANA 7.000% 01/02/2023 | USD | 1.416.333,37 | 1,38 |
| 550.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.500% 27/01/2025 | USD | 601.107,67 | 0,58 |
| | | | **2.017.441,04** | **1,96** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 400.000 | AEGEA FINANCE SARL 5.750% 10/10/2024 | USD | 410.975,95 | 0,40 |
| 700.000 | GAZPROM PJSC VIA GAZ CAPITAL SA 5.150% 11/02/2026 | USD | 780.920,07 | 0,76 |
| 700.000 | SBERBANK OF RUSSIA VIA SB CAPITAL SA 5.250% 23/05/2023 | USD | 737.929,67 | 0,71 |
| | | | **1.929.825,69** | **1,87** |
| | **Ägypten** | | | |
| 744.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 16/02/2026 | USD | 699.530,23 | 0,67 |
| 230.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 06/10/2025 | USD | 234.374,46 | 0,23 |
| 650.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 29/05/2024 | USD | 677.433,52 | 0,66 |
| 300.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.200% 01/03/2024 | USD | 315.449,08 | 0,31 |
| | | | **1.926.787,29** | **1,87** |
| | **Chile** | | | |
| 300.000 | CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 3.000% 17/07/2022 | USD | 305.285,55 | 0,30 |
| 800.000 | CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 3.875% 03/11/2021 | USD | 801.950,92 | 0,77 |
| 762.000 | CORP NACIONAL DEL COBRE DE CHILE 4.500% 13/08/2023 | USD | 809.378,99 | 0,79 |
| | | | **1.916.615,46** | **1,86** |
| | **Hongkong** | | | |
| 900.000 | BOCOM LEASING MANAGEMENT HONG KONG CO LTD 4.000% 22/01/2022 EMTN | USD | 907.750,31 | 0,88 |
| 200.000 | CITIC LTD 2.450% 25/02/2025 EMTN | USD | 204.625,06 | 0,20 |
| 200.000 | FAR EAST HORIZON LTD 2.625% 03/03/2024 EMTN | USD | 200.376,22 | 0,19 |
| 200.000 | FAR EAST HORIZON LTD 3.375% 18/02/2025 EMTN | USD | 201.832,55 | 0,20 |
| 500.000 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD 7.500% 17/02/2025 | USD | 325.021,51 | 0,32 |
| | | | **1.839.605,65** | **1,79** |
| | **Nigeria** | | | |
| 800.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 12/07/2023 | USD | 843.037,04 | 0,82 |
| 400.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/11/2025 | USD | 442.279,00 | 0,43 |
| 506.000 | SEPLAT ENERGY PLC 7.750% 01/04/2026 | USD | 526.796,43 | 0,51 |
| | | | **1.812.112,47** | **1,76** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 333.000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 2.634% 17/05/2026 | USD | 340.397,20 | 0,33 |
| 660.000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 5.250% 11/10/2023 EMTN | USD | 712.235,05 | 0,69 |
| 750.000 | CORP ANDINA DE FOMENTO 3.250% 11/02/2022 | USD | 757.504,76 | 0,74 |
| | | | **1.810.137,01** | **1,76** |
| | **Oman** | | | |
| 200.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 17/01/2023 | USD | 203.745,72 | 0,20 |
| 400.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 15/06/2026 | USD | 409.640,16 | 0,40 |
| 735.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN | USD | 763.711,38 | 0,74 |
| 400.000 | OMAN SOVEREIGN SUKUK CO 4.397% 01/06/2024 | USD | 412.619,56 | 0,40 |
| | | | **1.789.716,82** | **1,74** |
| | **Peru** | | | |
| 1.400.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.392% 23/01/2026 | USD | 1.430.719,70 | 1,39 |
| | | | **1.430.719,70** | **1,39** |
| | **Niederlande** | | | |
| 215.000 | MDGH - GMTN BV 2.500% 07/11/2024 | USD | 224.801,48 | 0,22 |
| 595.000 | SABIC CAPITAL II BV 4.000% 10/10/2023 | USD | 632.417,78 | 0,61 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 500.000 | VEON HOLDINGS BV 4.000% 09/04/2025 | USD | 524.902,22 | 0,51 |
| | | | **1.382.121,48** | **1,34** |
| | **Singapur** | | | |
| 300.000 | GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025 | USD | 309.544,10 | 0,30 |
| 285.000 | LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.250% 19/06/2024 | USD | 296.462,74 | 0,29 |
| 600.000 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD 4.250% 19/06/2024 EMTN | USD | 649.248,17 | 0,63 |
| | | | **1.255.255,01** | **1,22** |
| | **Georgien** | | | |
| 500.000 | GEORGIA INTERNATIONAL BOND 2.750% 22/04/2026 | USD | 506.356,48 | 0,49 |
| 700.000 | TBC BANK JSC 5.750% 19/06/2024 EMTN | USD | 748.826,53 | 0,73 |
| | | | **1.255.183,01** | **1,22** |
| | **Ghana** | | | |
| 1.100.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 07/04/2025 | USD | 848.591,17 | 0,83 |
| 400.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 18/01/2026 | USD | 405.037,78 | 0,39 |
| | | | **1.253.628,95** | **1,22** |
| | **China** | | | |
| 600.000 | SHOUGANG GROUP CO LTD 4.000% 23/05/2024 | USD | 632.335,44 | 0,61 |
| 600.000 | ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD 1.638% 14/07/2026 | USD | 593.957,95 | 0,58 |
| | | | **1.226.293,39** | **1,19** |
| | **Südafrika** | | | |
| 500.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 14/04/2026 | USD | 534.911,39 | 0,52 |
| 600.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 16/09/2025 | USD | 672.232,20 | 0,65 |
| | | | **1.207.143,59** | **1,17** |
| | **Trinidad und Tobago** | | | |
| 300.000 | TRINIDAD & TOBAGO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.375% 16/01/2024 | USD | 314.798,13 | 0,31 |
| 646.250 | TRINIDAD PETROLEUM HOLDINGS LTD 6.000% 08/05/2022 | USD | 648.738,81 | 0,63 |
| | | | **963.536,94** | **0,94** |
| | **Weißrussland** | | | |
| 650.000 | DEVELOPMENT BANK OF THE REPUBLIC OF BELARUS JSC 6.750% 02/05/2024 | USD | 611.925,66 | 0,60 |
| 300.000 | REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 5.875% 24/02/2026 | USD | 282.030,15 | 0,27 |
| | | | **893.955,81** | **0,87** |
| | **Kolumbien** | | | |
| 400.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 26/02/2024 | USD | 418.529,08 | 0,41 |
| 450.000 | ECOPETROL SA 4.125% 16/01/2025 | USD | 468.506,12 | 0,45 |
| | | | **887.035,20** | **0,86** |
| | **Kenia** | | | |
| 800.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 24/06/2024 | USD | 876.134,10 | 0,85 |
| | | | **876.134,10** | **0,85** |
| | **Israel** | | | |
| 800.000 | ENERGEAN ISRAEL FINANCE LTD 4.500% 30/03/2024 | USD | 816.361,21 | 0,79 |
| | | | **816.361,21** | **0,79** |
| | **Ukraine** | | | |
| 250.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 01/09/2023 | USD | 267.231,12 | 0,26 |
| 300.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 01/09/2025 | USD | 325.605,53 | 0,32 |
| 200.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.994% 01/02/2024 | USD | 220.030,14 | 0,21 |
| | | | **812.866,79** | **0,79** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 202.000 | UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 7.875% 15/07/2026 | USD | 204.702,80 | 0,20 |
| 510.000 | UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 8.250% 09/07/2024 | USD | 531.777,19 | 0,52 |
| | | | **736.479,99** | **0,72** |
| | **Namibia** | | | |
| 300.000 | NAMIBIA INTERNATIONAL BONDS 5.250% 29/10/2025 | USD | 321.089,40 | 0,31 |
| 400.000 | NAMIBIA INTERNATIONAL BONDS 5.500% 03/11/2021 | USD | 400.994,42 | 0,39 |
| | | | **722.083,82** | **0,70** |
| | **Mauritius** | | | |
| 680.000 | GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 16/08/2023 | USD | 683.584,35 | 0,66 |
| | | | **683.584,35** | **0,66** |
| | **Jordanien** | | | |
| 610.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 07/07/2025 | USD | 636.301,87 | 0,62 |
| | | | **636.301,87** | **0,62** |
| | **Südkorea** | | | |
| 400.000 | KB KOOKMIN CARD 1.500% 13/05/2026 | USD | 397.379,48 | 0,39 |
| 200.000 | MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD 2.625% 30/07/2025 | USD | 205.157,34 | 0,20 |
| | | | **602.536,82** | **0,59** |
| | **Kuwait** | | | |
| 500.000 | KUWAIT INTERNATIONAL GOVERNMENT BOND 2.750% 20/03/2022 | USD | 504.963,78 | 0,49 |
| | | | **504.963,78** | **0,49** |
| | **Paraguay** | | | |
| 430.000 | BANCO CONTINENTAL SAECA 2.750% 10/12/2025 | USD | 427.577,88 | 0,42 |
| | | | **427.577,88** | **0,42** |
| | **Malaysia** | | | |
| 400.000 | PETRONAS CAPITAL LTD 7.875% 22/05/2022 | USD | 418.432,24 | 0,41 |
| | | | **418.432,24** | **0,41** |
| | **Costa Rica** | | | |
| 400.000 | INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD 6.950% 10/11/2021 | USD | 400.877,74 | 0,39 |
| | | | **400.877,74** | **0,39** |
| | **El Salvador** | | | |
| 150.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2025 | USD | 114.767,79 | 0,11 |
| 300.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 24/01/2023 | USD | 252.886,56 | 0,25 |
| | | | **367.654,35** | **0,36** |
| | **Jersey** | | | |
| 350.000 | WEST CHINA CEMENT LTD 4.950% 08/07/2026 | USD | 340.937,05 | 0,33 |
| | | | **340.937,05** | **0,33** |
| | **Aserbaidschan** | | | |
| 300.000 | REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 4.750% 18/03/2024 | USD | 320.858,94 | 0,31 |
| | | | **320.858,94** | **0,31** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Schweden** | | | |
| 300.000 | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA VIA PKO FINANCE AB 4.630% 26/09/2022 | USD | 311.212,84 | 0,30 |
| | | | **311.212,84** | **0,30** |
| | **Thailand** | | | |
| 300.000 | INDORAMA VENTURES GLOBAL SERVICES LTD 4.375% 12/09/2024 | USD | 304.963,54 | 0,30 |
| | | | **304.963,54** | **0,30** |
| | **Indien** | | | |
| 300.000 | ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% 08/09/2024 | USD | 300.628,08 | 0,29 |
| | | | **300.628,08** | **0,29** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 300.000 | WIPRO IT SERVICES LLC 1.500% 23/06/2026 | USD | 298.423,18 | 0,29 |
| | | | **298.423,18** | **0,29** |
| | **Russland** | | | |
| 200.000 | RUSSIAN FOREIGN BOND - EUROBOND 4.750% 27/05/2026 | USD | 225.263,03 | 0,22 |
| | | | **225.263,03** | **0,22** |
| | | | **97.484.498,96** | **94,70** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **97.484.498,96** | **94,70** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swaps** | | | | | | |
| CDS REPUBLIC OF TURKEY 5.000% 20/06/2024 | Kauf | 1,000 | 20/06/2024 | USD | 1.000.000,00 | 74.584,72 |
| CDS REPUBLIC OF TURKEY 5.000% 20/06/2024 | Kauf | 1,000 | 20/12/2024 | USD | 750.000,00 | 67.110,35 |
| CDS REPUBLIC OF TURKEY 5.000% 20/06/2024 | Kauf | 1,000 | 20/12/2025 | USD | 500.000,00 | 59.519,51 |
| CDS REPUBLIC OF TURKEY 5.000% 20/06/2024 | Kauf | 1,000 | 20/06/2024 | USD | 700.000,00 | 52.209,30 |
| CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 1.000.000,00 | (27.268,25) |
| CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 2.000.000,00 | (54.536,50) |
| CDS PEOPLE'S REPUBLIC OF CHINA 1.000% 20/06/2027 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 3.000.000,00 | (81.804,75) |
| | | | | | | **89.814,38** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäft** | | | | | | |
| 2.293,33 | EUR | 2.721,08 | USD | 19/10/2021 | 2.721,08 | (62,44) |
| | | | | | **2.721,08** | **(62,44)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Future** | | | | |
| (37) | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 4.541.460,96 | 19.890,60 |
| | | | **4.541.460,96** | **19.890,60** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **109.642,54** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **97.484.498,96** | **94,70** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **109.642,54** | **0,11** |
| **Bankguthaben** | **4.437.126,22** | **4,31** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **904.727,08** | **0,88** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **102.935.994,80** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 700.781.355,34 |
| | 30.09.2020 | USD | 197.163.900,26 |
| | 30.09.2019 | USD | 136.783.161,88 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.726,31 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.893,76 |
| | 30.09.2020 | USD | 4.135,23 |
| | 30.09.2019 | USD | 3.710,07 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 19.462,29 |
| | 30.09.2020 | PLN | 16.625,59 |
| | 30.09.2019 | PLN | 15.166,83 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 383,25 |
| | 30.09.2020 | EUR | 320,37 |
| | 30.09.2019 | EUR | 309,43 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 363,57 |
| | 30.09.2020 | EUR | 304,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 295,02 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.449,00 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.076,54 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.869,32 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 293,91 |
| | 30.09.2020 | USD | 248,59 |
| | 30.09.2019 | USD | 223,22 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 60.695,17 |
| | 30.09.2020 | HUF | 51.679,17 |
| | 30.09.2019 | HUF | 46.383,85 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.225,27 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.895,82 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.714,81 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 230,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 205,87 |
| | 30.09.2020 | USD | 177,20 |
| | 30.09.2019 | USD | 161,93 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 131.932,67 |
| | 30.09.2020 | EUR | 110.076,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 106.121,89 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.551,26 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.332,92 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.225,09 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 276,21 |
| | 30.09.2020 | USD | 237,22 |
| | 30.09.2019 | USD | 218,66 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 13.607 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 400 |
| | 30.09.2020 | | 735 |
| | 30.09.2019 | | 128 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | | 7.197 |
| | 30.09.2020 | | 4.366 |
| | 30.09.2019 | | 1.523 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 1.453 |
| | 30.09.2020 | | 1.326 |
| | 30.09.2019 | | 2.112 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 3.158 |
| | 30.09.2020 | | 3.220 |
| | 30.09.2019 | | 4.100 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 10.034 |
| | 30.09.2020 | | 10.223 |
| | 30.09.2019 | | 20.761 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | | 2.675 |
| | 30.09.2020 | | 2.903 |
| | 30.09.2019 | | 3.714 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | | 334 |
| | 30.09.2020 | | 517 |
| | 30.09.2019 | | 702 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | | 3.402 |
| | 30.09.2020 | | 2.991 |
| | 30.09.2019 | | 4.076 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 8 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | | 10.811 |
| | 30.09.2020 | | 10.161 |
| | 30.09.2019 | | 14.657 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 3.486 |
| | 30.09.2020 | | 1.096 |
| | 30.09.2019 | | 659 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | | 1.361 |
| | 30.09.2020 | | 1.423 |
| | 30.09.2019 | | 1.923 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 3.328 |
| | 30.09.2020 | 3.485 |
| | 30.09.2019 | 3.693 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 20,25 |
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 4,15 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,26% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,26% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,28% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,35% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 0,35% |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 1,10% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,10% |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,09% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 2,10% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,16% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 0,35% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 48,68% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **697.822.144,79** |
| Aktien | | 697.820.588,12 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 1.556,67 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **94.582,78** |
| Optionsscheine und Bezugsrechte | | 94.582,78 |
| **Bankguthaben** | | **2.149.939,63** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **3.238.646,14** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***703.305.313,34*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(1.137,01)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(906.459,62)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(1.616.361,37)** |
| Devisentermingeschäfte | | (1.616.361,37) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(2.523.958,00)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***700.781.355,34*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **12.447.021,88** |
| Dividenden | | 12.447.021,88 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.312.456,79)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (300.796,12) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (893.912,86) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (6.266,54) |
| Abonnementsteuer | 9 | (79.281,99) |
| Bankzinsen | | (13.593,64) |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | (22,81) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (18.582,83) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **11.134.565,09** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 34.811.598,43 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (8.040.669,07) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 74.703,57 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (987.651,97) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 5.954.078,37 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (6.542.271,14) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (729.960,99) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (595.154,18) |
| **Ergebnis** | | **35.079.238,11** |
| Zeichnungen | | 549.044.452,22 |
| Rücknahmen | | (80.461.733,11) |
| Ausschüttung | | (44.502,14) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 197.163.900,26 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***700.781.355,34*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

#### Kaimaninseln

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 151.000 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC | HKD | 718.458,76 | 0,10 |
| 50.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 46.619,48 | 0,01 |
| 1.485.000 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | HKD | 27.045.320,78 | 3,87 |
| 177.000 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | HKD | 3.327.862,75 | 0,47 |
| 7.700 | AUTOHOME INC ADR | USD | 361.361,00 | 0,05 |
| 29.500 | BAIDU INC ADR | USD | 4.535.625,00 | 0,65 |
| 17.600 | BAOZUN INC ADR | USD | 308.528,00 | 0,04 |
| 6.100 | BEIGENE LTD ADR | USD | 2.214.300,00 | 0,32 |
| 888.000 | BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 630.069,97 | 0,09 |
| 122.220 | CHAILEASE HOLDING CO LTD | TWD | 1.075.953,88 | 0,15 |
| 59.000 | CHINA AOYUAN GROUP LTD | HKD | 31.057,03 | 0,00 |
| 253.000 | CHINA EDUCATION GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 434.849,66 | 0,06 |
| 185.000 | CHINA EVERGRANDE GROUP | HKD | 69.897,21 | 0,01 |
| 366.000 | CHINA FEIHE LTD | HKD | 615.945,84 | 0,09 |
| 219.000 | CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 350.045,73 | 0,05 |
| 47.600 | CHINA LITERATURE LTD | HKD | 362.125,81 | 0,05 |
| 161.000 | CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD | HKD | 292.806,23 | 0,04 |
| 149.796 | CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD | HKD | 750.141,27 | 0,11 |
| 470.000 | CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD | HKD | 3.018.803,72 | 0,43 |
| 110.000 | CHINA OVERSEAS PROPERTY | HKD | 91.010,46 | 0,01 |
| 468.000 | CHINA RESOURCES LAND LTD | HKD | 1.969.007,27 | 0,28 |
| 628.000 | CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD | HKD | 304.030,77 | 0,04 |
| 790.000 | CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD | HKD | 536.252,16 | 0,08 |
| 700.219 | COUNTRY GARDEN HOLDINGS CO LTD | HKD | 721.931,26 | 0,10 |
| 176.000 | COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD | HKD | 1.386.289,31 | 0,20 |
| 745.500 | DALI FOODS GROUP CO LTD | HKD | 448.757,36 | 0,06 |
| 144.000 | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | HKD | 2.368.064,90 | 0,34 |
| 898.000 | GEELY AUTOMOBILE HOLDINGS LTD | HKD | 2.570.513,85 | 0,37 |
| 202.000 | GENSCRIPT BIOTECH CORP | HKD | 776.137,58 | 0,11 |
| 46.000 | GREENTOWN SERVICE GROUP CO LTD | HKD | 49.488,38 | 0,01 |
| 113.000 | HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 348.064,40 | 0,05 |
| 168.000 | HANSOH PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD | HKD | 426.030,36 | 0,06 |
| 4.900 | HUYA INC - ADR | USD | 40.866,00 | 0,01 |
| 144.000 | INNOVENT BIOLOGICS INC | HKD | 1.392.436,93 | 0,20 |
| 25.900 | IQIYI INC ADR | USD | 207.977,00 | 0,03 |
| 259.031 | JINXIN FERTILITY GROUP LTD | HKD | 384.836,12 | 0,05 |
| 228.285 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 61.983,97 | 0,01 |
| 393.500 | KINGBOARD LAMINATES HOLDINGS LTD | HKD | 649.122,52 | 0,09 |
| 399.000 | KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP CO LTD | HKD | 1.331.210,41 | 0,19 |
| 150.800 | KINGSOFT CORP LTD | HKD | 599.693,07 | 0,09 |
| 329.000 | KWG PROPERTY HOLDING LTD | HKD | 320.661,37 | 0,05 |
| 817.000 | LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD | HKD | 599.573,98 | 0,09 |
| 288.000 | LI NING CO LTD | HKD | 3.325.250,00 | 0,47 |
| 280.000 | LOGAN GROUP CO LTD | HKD | 291.909,69 | 0,04 |
| 246.500 | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 1.133.385,00 | 0,16 |
| 412.200 | MEITUAN - B | HKD | 13.018.685,80 | 1,86 |
| 72.600 | MICROPORT SCIENTIFIC CORP | HKD | 408.194,58 | 0,06 |
| 42.700 | NETEASE INC ADR | USD | 3.646.580,00 | 0,52 |
| 11.600 | NOAH HOLDINGS LTD ADR | USD | 430.708,00 | 0,06 |
| 49.100 | PINDUODUO INC - ADR | USD | 4.451.897,00 | 0,64 |
| 41.100 | PING AN HEALTHCARE AND TECHNOLOGY CO LTD | HKD | 266.353,51 | 0,04 |
| 278.000 | SEAZEN GROUP LTD | HKD | 221.819,08 | 0,03 |
| 52.500 | SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 95.883,73 | 0,01 |
| 12.000 | SILERGY CORP | TWD | 1.762.831,00 | 0,25 |
| 993.000 | SINO BIOPHARMACEUTICAL LTD | HKD | 821.576,26 | 0,12 |
| 322.000 | SSY GROUP LTD | HKD | 173.621,73 | 0,02 |
| 83.000 | SUNAC CHINA HOLDINGS LTD | HKD | 176.462,44 | 0,03 |
| 116.200 | SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | HKD | 3.047.910,18 | 0,43 |
| 81.300 | TAL EDUCATION GROUP ADR | USD | 393.492,00 | 0,06 |
| 551.100 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 32.566.724,98 | 4,65 |
| 36.000 | TINGYI CAYMAN ISLANDS HOLDING CORP | HKD | 66.763,20 | 0,01 |
| 338.800 | TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD | HKD | 816.637,11 | 0,12 |
| 487.000 | TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 555.117,69 | 0,08 |
| 64.000 | UNI-PRESIDENT CHINA HOLDINGS LTD | HKD | 60.738,53 | 0,01 |
| 56.000 | VINDA INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 164.961,25 | 0,02 |
| 52.700 | VIPSHOP HOLDINGS LTD ADR | USD | 587.078,00 | 0,08 |
| 6.000 | WEIBO CORP ADR | USD | 284.940,00 | 0,04 |
| 198.000 | WEIMOB INC | HKD | 286.048,95 | 0,04 |
| 382.051 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | HKD | 6.189.819,06 | 0,88 |
| 765.985 | XINYI SOLAR HOLDINGS LTD | HKD | 1.565.738,52 | 0,22 |
| 336.671 | YADEA GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 548.477,63 | 0,08 |
| 103.000 | YIHAI INTERNATIONAL HOLDING LTD | HKD | 571.863,54 | 0,08 |
| 83.000 | ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD | TWD | 293.758,65 | 0,04 |
| 139.000 | ZHONGSHENG GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 1.116.216,47 | 0,16 |
| 251.000 | 3SBIO INC | HKD | 245.924,19 | 0,04 |
| 11.373 | 360 DIGITECH INC - ADR | USD | 231.099,36 | 0,03 |
| 4.500 | 51JOB INC ADR | USD | 312.885,00 | 0,04 |
| | | | **143.905.063,68** | **20,53** |

#### Taiwan

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 57.000 | ACCTON TECHNOLOGY CORP | TWD | 536.471,77 | 0,08 |
| 537.000 | ACER INC | TWD | 475.626,18 | 0,07 |
| 153.493 | ADVANTECH CO LTD | TWD | 2.004.923,05 | 0,29 |
| 104.000 | ASUSTEK COMPUTER INC | TWD | 1.211.436,36 | 0,17 |
| 1.058.000 | AU OPTRONICS CORP | TWD | 668.261,82 | 0,10 |
| 132.000 | CATCHER TECHNOLOGY CO LTD | TWD | 791.234,13 | 0,11 |
| 404.000 | CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 837.097,80 | 0,12 |
| 1.989.000 | CHINA STEEL CORP | TWD | 2.583.792,78 | 0,36 |
| 98.000 | CHUNGHWA TELECOM CO LTD | TWD | 387.529,37 | 0,06 |
| 674.000 | COMPAL ELECTRONICS INC | TWD | 569.230,52 | 0,08 |
| 778.000 | CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 637.575,11 | 0,09 |
| 342.000 | DELTA ELECTRONICS INC | TWD | 3.084.202,73 | 0,44 |
| 19.000 | ECLAT TEXTILE CO LTD | TWD | 412.722,90 | 0,06 |
| 1.135.785 | E.SUN FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 1.068.976,48 | 0,14 |
| 210.000 | EVERGREEN MARINE CORP TAIWAN LTD | TWD | 946.904,35 | 0,14 |
| 79.480 | FENG TAY ENTERPRISE CO LTD | TWD | 611.522,71 | 0,09 |
| 315.349 | FIRST FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 254.480,37 | 0,04 |
| 139.000 | FOXCONN TECHNOLOGY CO LTD | TWD | 349.692,56 | 0,05 |
| 576.400 | FUBON FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 1.582.106,10 | 0,23 |
| 33.718 | HIWIN TECHNOLOGIES CORP | TWD | 373.455,39 | 0,05 |
| 1.599.000 | HON HAI PRECISION INDUSTRY CO LTD | TWD | 6.008.333,54 | 0,85 |
| 1.036.000 | INNOLUX CORP | TWD | 630.267,55 | 0,09 |
| 219.000 | INVENTEC CORP | TWD | 202.199,50 | 0,03 |
| 12.000 | LARGAN PRECISION CO LTD | TWD | 940.462,82 | 0,13 |
| 428.000 | LITE-ON TECHNOLOGY CORP ADR | TWD | 957.282,37 | 0,14 |
| 170.000 | MEDIATEK INC | TWD | 5.505.715,57 | 0,79 |
| 825.000 | MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 946.233,35 | 0,14 |
| 118.000 | MICRO-STAR INTERNATIONAL CO LTD | TWD | 546.849,79 | 0,08 |
| 8.000 | MOMO.COM INC | TWD | 463.789,88 | 0,07 |
| 45.000 | NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP | TWD | 700.515,97 | 0,10 |
| 389.000 | NANYA TECHNOLOGY CORP | TWD | 917.384,27 | 0,13 |
| 82.000 | NOVATEK MICROELECTRONICS CORP | TWD | 1.203.133,94 | 0,17 |
| 376.000 | PEGATRON CORP | TWD | 901.527,37 | 0,13 |
| 263.000 | POU CHEN CORP | TWD | 317.647,76 | 0,05 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 237.000 | POWERTECH TECHNOLOGY INC | TWD | 886.300,33 | 0,13 |
| 95.000 | PRESIDENT CHAIN STORE CORP | TWD | 951.914,42 | 0,14 |
| 68.000 | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | TWD | 1.205.782,13 | 0,17 |
| 212.000 | SYNNEX TECHNOLOGY INTERNATIONAL CORP | TWD | 396.025,03 | 0,06 |
| 2.412.000 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 50.063.541,43 | 7,13 |
| 195.000 | UNIMICRON TECHNOLOGY CORP | TWD | 921.138,24 | 0,13 |
| 632.000 | UNI-PRESIDENT ENTERPRISES CORP | TWD | 1.544.735,24 | 0,22 |
| 1.391.000 | UNITED MICROELECTRONICS CORP | TWD | 3.185.835,70 | 0,44 |
| 190.000 | VANGUARD INTERNATIONAL SEMICONDUCTOR CORP | TWD | 1.030.107,40 | 0,15 |
| 51.000 | WIN SEMICONDUCTORS CORP | TWD | 565.780,72 | 0,08 |
| 414.000 | WINBOND ELECTRONICS CORP | TWD | 392.611,03 | 0,06 |
| 526.000 | WISTRON CORP | TWD | 517.648,21 | 0,07 |
| 15.000 | WIWYNN CORP | TWD | 467.010,65 | 0,07 |
| 57.000 | YAGEO CORP | TWD | 902.618,86 | 0,13 |
| 142.000 | YANG MING MARINE TRANSPORT CORP | TWD | 607.256,99 | 0,09 |
| 569.880 | YUANTA FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 503.728,63 | 0,07 |
| | | | **103.770.621,17** | **14,81** |
| | **China** | | | |
| 1.625.700 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD - A | CNH | 738.352,94 | 0,11 |
| 3.916.000 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD -H | HKD | 1.344.137,26 | 0,19 |
| 35.250 | A-LIVING SMART CITY SERVICES CO LTD | HKD | 125.056,13 | 0,02 |
| 2.232.000 | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD - H | HKD | 1.683.741,96 | 0,24 |
| 242.500 | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD - H | HKD | 1.304.449,05 | 0,19 |
| 97.500 | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD-A | CNH | 614.527,03 | 0,09 |
| 83.091 | AVARY HOLDING SHENZHEN CO LTD - A | CNH | 427.824,37 | 0,06 |
| 1.020.500 | BANK OF CHINA LTD - A | CNH | 480.827,22 | 0,07 |
| 9.569.000 | BANK OF CHINA LTD - H | HKD | 3.382.529,92 | 0,47 |
| 1.576.000 | BANK OF COMMUNICATIONS CO LTD - H | HKD | 932.533,09 | 0,13 |
| 100.300 | BANK OF NINGBO CO LTD - A | CNH | 544.631,15 | 0,08 |
| 302.000 | BEIJING CAPITAL INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD - H | HKD | 177.535,72 | 0,03 |
| 15.020 | BEIJING SHIJI INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 59.121,52 | 0,01 |
| 10.400 | BEIJING TIANTAN BIOLOGICAL PRODUCTS CORP LTD - A | CNH | 51.427,48 | 0,01 |
| 21.700 | BYD CO LTD - H | CNH | 836.419,03 | 0,12 |
| 89.500 | BYD CO LTD - H | HKD | 2.785.450,18 | 0,40 |
| 5.900 | CHANGCHUN HIGH & NEW TECHNOLOGY INDUSTRY GROUP INC - A | CNH | 250.336,19 | 0,04 |
| 532.000 | CHINA BOHAI BANK CO LTD -H | HKD | 207.133,96 | 0,03 |
| 380.000 | CHINA CITIC BANK CORP LTD - H | HKD | 171.313,80 | 0,02 |
| 11.126.000 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP - H | HKD | 7.951.321,50 | 1,12 |
| 713.000 | CHINA EVERBRIGHT BANK CO LTD - H | HKD | 251.124,03 | 0,04 |
| 360.000 | CHINA GALAXY SECURITIES CO LTD - H | HKD | 208.865,53 | 0,03 |
| 15.600 | CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD - A | CNH | 137.895,05 | 0,02 |
| 135.200 | CHINA INTERNATIONAL CAPITAL CORP LTD - H | HKD | 354.108,28 | 0,05 |
| 1.172.000 | CHINA LIFE INSURANCE CO LTD - H | HKD | 1.918.335,45 | 0,27 |
| 136.100 | CHINA MERCHANTS BANK CO LTD - A | CNH | 1.060.707,18 | 0,15 |
| 498.000 | CHINA MERCHANTS BANK CO LTD - H | HKD | 3.957.648,44 | 0,56 |
| 205.000 | CHINA MINSHENG BANKING CORP LTD - H | HKD | 82.179,65 | 0,01 |
| 2.157.000 | CHINA MOLYBDENUM CO LTD - H | HKD | 1.339.855,64 | 0,19 |
| 838.000 | CHINA NATIONAL BUILDING MATERIAL CO LTD - H | HKD | 1.131.229,44 | 0,16 |
| 450.200 | CHINA PACIFIC INSURANCE GROUP CO LTD - H | HKD | 1.334.819,56 | 0,19 |
| 78.000 | CHINA SOUTHERN AIRLINES CO LTD | HKD | 43.955,51 | 0,01 |
| 22.896 | CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CORP LTD - A | CNH | 919.621,64 | 0,13 |
| 5.176.000 | CHINA TOWER CORP LTD - H | HKD | 676.176,90 | 0,09 |
| 55.100 | CHINA VANKE CO LTD - A | CNH | 181.389,13 | 0,03 |
| 248.300 | CHINA VANKE CO LTD - H | HKD | 677.364,47 | 0,10 |
| 181.960 | CHONGQING CHANGAN AUTOMOBILE CO LTD - A | CNH | 469.427,59 | 0,07 |
| 13.000 | CHONGQING ZHIFEI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD | CNH | 319.292,99 | 0,05 |
| 403.000 | CITIC SECURITIES CO LTD - H | HKD | 1.024.030,27 | 0,15 |
| 24.100 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 1.957.293,79 | 0,28 |
| 698.794 | COSCO SHIPPING ENERGY TRANSPORTATION CO LTD | CNH | 739.462,21 | 0,11 |
| 583.700 | COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H | HKD | 892.606,65 | 0,13 |
| 12.000 | DONG-E-E-JIAO CO LTD - A | CNH | 64.919,27 | 0,01 |
| 956.000 | DONGFENG MOTOR GROUP CO LTD - H | HKD | 850.959,31 | 0,12 |
| 24.200 | EVE ENERGY CO LTD - A | CNH | 370.218,71 | 0,05 |
| 59.900 | FOCUS MEDIA INFORMATION TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 67.735,15 | 0,01 |
| 405.251 | FOXCONN INDUSTRIAL INTERNET CO LTD | CNH | 727.455,50 | 0,10 |
| 26.200 | GANFENG LITHIUM CO LTD - A | CNH | 659.485,45 | 0,09 |
| 58.995 | GANFENG LITHIUM CO LTD - H | HKD | 1.045.724,74 | 0,15 |
| 183.000 | GEM CO LTD - A | CNH | 316.059,69 | 0,05 |
| 182.000 | GF SECURITIES CO LTD - H | HKD | 316.546,29 | 0,05 |
| 6.300 | GIGADEVICE SEMICONDUCTOR BEIJING INC - A | CNH | 141.109,03 | 0,02 |
| 86.500 | GOERTEK INC - A | CNH | 575.929,85 | 0,08 |
| 6.600 | GOTION HIGH-TECH CO LTD - A | CNH | 48.419,73 | 0,01 |
| 36.000 | GUANGDONG HAID GROUP CO LTD - A | CNH | 374.833,68 | 0,05 |
| 81.700 | GUANGDONG HONGDA BLASTING CO LTD - A | CNH | 342.411,28 | 0,05 |
| 7.500 | GUANGDONG KINLONG HARDWARE PRODUCTS CO LTD - A | CNH | 159.158,33 | 0,02 |
| 782.000 | GUANGZHOU AUTOMOBILE GROUP CO LTD - H | HKD | 689.066,70 | 0,10 |
| 28.400 | GUANGZHOU TINCI MATERIALS TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 667.391,81 | 0,10 |
| 151.800 | HAIER CO LTD -A | CNH | 613.224,75 | 0,09 |
| 302.000 | HAIER SMART HOME CO LTD - A | HKD | 1.061.733,14 | 0,15 |
| 436.800 | HAITONG SECURITIES CO LTD | HKD | 398.876,31 | 0,06 |
| 64.000 | HANGZHOU ROBAM APPLIANCES CO LTD - A | CNH | 334.174,18 | 0,05 |
| 31.200 | HANGZHOU TIGERMED CONSULTING CO LTD - H | HKD | 662.129,88 | 0,09 |
| 18.053 | HEFEI MEIYA OPTOELECTRONIC TECHNOLOGY INC - A | CNH | 106.060,07 | 0,02 |
| 39.400 | HENAN SHUANGHUI INVESTMENT & DEVELOPMENT CO LTD -A | CNH | 165.250,30 | 0,02 |
| 368.200 | HUATAI SECURITIES CO LTD - H | HKD | 566.831,95 | 0,08 |
| 157.480 | HUAYU AUTOMOTIVE SYSTEMS CO LTD - A | CNH | 555.158,85 | 0,08 |
| 541.467 | HUNAN VALIN STEEL CO LTD - A | CNH | 554.576,81 | 0,08 |
| 15.820 | HUNDSUN TECHNOLOGIES INC - A | CNH | 139.986,35 | 0,02 |
| 38.700 | IFLYTEK CO LTD - A | CNH | 316.258,97 | 0,05 |
| 1.196.000 | INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD - A | CNH | 860.980,46 | 0,12 |
| 6.241.000 | INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD - H | HKD | 3.461.052,65 | 0,48 |
| 224.800 | INDUSTRIAL BANK CO LTD - A | CNH | 635.511,79 | 0,09 |
| 140.700 | INNER MONGOLIA YILI INDUSTRIAL GROUP CO LTD - A | CNH | 819.429,63 | 0,12 |
| 174.000 | JIANGSU EXPRESSWAY CO LTD - H | HKD | 175.829,73 | 0,03 |
| 19.600 | JIANGSU HENGLI HYDRAULIC CO LTD - A | CNH | 256.094,33 | 0,04 |
| 9.700 | JONJEE HI-TECH INDUSTRIAL AND COMMERCIAL HOLDING CO LTD - A | CNH | 47.711,27 | 0,01 |
| 13.100 | JUEWEI FOOD CO LTD - A | CNH | 129.416,03 | 0,02 |
| 137.900 | KINGFA SCI & TECH CO LTD - A | CNH | 312.514,80 | 0,04 |
| 106.500 | LENS TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 344.181,48 | 0,05 |
| 58.000 | LIAONING CHENG DA CO LTD - A | CNH | 221.310,06 | 0,03 |
| 78.460 | LONGI GREEN ENERGY TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 999.708,01 | 0,14 |
| 95.000 | MIDEA GROUP CO LTD - A | CNH | 1.021.431,07 | 0,15 |
| 50.900 | MUYUAN FOODS CO LTD - A | CNH | 408.095,08 | 0,06 |
| 32.900 | NARI TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 182.510,36 | 0,03 |
| 7.100 | NAURA TECHNOLOGY GROUP CO LTD - A | CNH | 401.095,37 | 0,06 |
| 166.900 | NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD - H | HKD | 491.643,45 | 0,07 |
| 83.400 | NEW HOPE LIUHE CO LTD - A | CNH | 190.164,13 | 0,03 |
| 40.000 | NINESTAR CORP - A | CNH | 230.795,22 | 0,03 |
| 1.887.000 | PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP - H | HKD | 584.862,01 | 0,08 |
| 37.809 | PHARMARON BEIJING CO LTD - H | HKD | 902.140,40 | 0,13 |
| 1.036.000 | PICC PROPERTY & CASUALTY CO LTD - H | HKD | 1.001.781,05 | 0,14 |
| 221.100 | PING AN BANK CO LTD - A | CNH | 612.414,18 | 0,09 |
| 51.300 | PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD - A | CNH | 383.247,98 | 0,05 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 708.500 | PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD - H | HKD | 4.831.984,74 | 0,69 |
| 25.000 | POLY PROPERTY SERVICES CO LTD | HKD | 148.567,59 | 0,02 |
| 662.892 | POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD - A | CNH | 520.214,82 | 0,07 |
| 1.024.000 | POSTAL SAVINGS BANK OF CHINA CO LTD - H | HKD | 705.583,37 | 0,10 |
| 236.200 | SAIC MOTOR CORP LTD - A | CNH | 696.200,74 | 0,10 |
| 133.500 | SANY HEAVY INDUSTRY CO LTD - A | CNH | 524.655,93 | 0,07 |
| 12.000 | SEAZEN HOLDINGS CO LTD - A | CNH | 69.108,80 | 0,01 |
| 404.000 | SHANDONG WEIGAO GROUP MEDICAL POLYMER CO LTD - H | HKD | 720.255,66 | 0,10 |
| 13.860 | SHANGHAI BAOSIGHT SOFTWARE CO LTD - A | CNH | 141.313,41 | 0,02 |
| 101.500 | SHANGHAI FOSUN PHARMACEUTICAL GROUP CO LTD - H | HKD | 520.636,54 | 0,07 |
| 43.500 | SHANGHAI INTERNATIONAL AIRPORT CO LTD - A | CNH | 297.357,40 | 0,04 |
| 24.200 | SHANGHAI PHARMACEUTICALS HOLDING CO LTD - H | HKD | 46.863,34 | 0,01 |
| 125.096 | SHANGHAI PUDONG DEVELOPMENT BANK CO LTD - A | CNH | 173.925,05 | 0,02 |
| 39.766 | SHANGHAI PUTAILAI NEW ENERGY TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 1.056.614,51 | 0,15 |
| 23.200 | SHANGHAI YUYUAN TOURIST MART GROUP CO LTD - A | CNH | 36.592,32 | 0,01 |
| 40.200 | SHENGYI TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 134.511,90 | 0,02 |
| 7.275 | SHENZHEN GOODIX TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 124.500,35 | 0,02 |
| 35.950 | SHENZHEN INOVANCE TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 349.877,21 | 0,05 |
| 5.400 | SHENZHEN KANGTAI BIOLOGICAL PRODUCTS CO LTD | CNH | 91.870,40 | 0,01 |
| 10.800 | SHENZHEN MINDRAY BIO-MEDICAL ELECTRONICS CO LTD - A | CNH | 643.034,42 | 0,09 |
| 322.800 | SHENZHEN OVERSEAS CHINESE TOWN CO LTD - A | CNH | 373.500,81 | 0,05 |
| 13.200 | SHENZHEN SC NEW ENERGY TECHNOLOGY CORP - A | CNH | 280.179,84 | 0,04 |
| 156.800 | SINOPHARM GROUP CO LTD - H | HKD | 407.669,47 | 0,06 |
| 17.300 | SUNGROW POWER SUPPLY CO LTD - A | CNH | 396.549,76 | 0,06 |
| 402.800 | SUNING.COM CO LTD - A | CNH | 310.503,32 | 0,04 |
| 6.681 | THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 129.207,38 | 0,02 |
| 33.500 | TIANJIN ZHONGHUAN SEMICONDUCTOR CO LTD - A | CNH | 237.383,08 | 0,03 |
| 64.500 | TONGWEI CO LTD - A | CNH | 507.568,75 | 0,07 |
| 4.200 | TOPCHOICE MEDICAL CORP - A | CNH | 195.957,19 | 0,03 |
| 325.000 | TRAVELSKY TECHNOLOGY LTD - H | HKD | 624.368,10 | 0,09 |
| 3.200 | UNIGROUP GUOXIN MICROELECTRONICS CO LTD -A | CNH | 102.229,62 | 0,01 |
| 25.940 | UNISPLENDOUR CORP LTD - A | CNH | 99.940,76 | 0,01 |
| 89.200 | UNIVERSAL SCIENTIFIC INDUSTRIAL SHANGHAI CO LTD - A | CNH | 190.987,22 | 0,03 |
| 4.000 | WALVAX BIOTECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 39.040,54 | 0,01 |
| 38.300 | WEICHAI POWER CO LTD - A | CNH | 101.529,51 | 0,01 |
| 341.000 | WEICHAI POWER CO LTD - H | HKD | 706.641,24 | 0,10 |
| 122.660 | WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD - A | CNH | 274.187,54 | 0,04 |
| 12.600 | WILL SEMICONDUCTOR CO LTD SHANGHAI - A | CNH | 472.232,05 | 0,07 |
| 17.300 | WINGTECH TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 250.309,00 | 0,04 |
| 107.147 | WUHAN GUIDE INFRARED CO LTD - A | CNH | 386.990,89 | 0,06 |
| 82.180 | WUXI APPTEC CO LTD - H | HKD | 1.916.647,15 | 0,27 |
| 41.600 | WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD - A | CNH | 448.693,10 | 0,06 |
| 125.200 | XINJIANG GOLDWIND SCIENCE & TECHNOLOGY CO LTD - H | HKD | 262.974,87 | 0,04 |
| 27.850 | YEALINK NETWORK TECHNOLOGY CORP LTD - A | CNH | 349.562,46 | 0,05 |
| 7.500 | YIFENG PHARMACY CHAIN CO LTD - A | CNH | 60.340,44 | 0,01 |
| 143.600 | YONGHUI SUPERSTORES CO LTD - A | CNH | 86.959,43 | 0,01 |
| 52.830 | YONYOU NETWORK TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 270.382,30 | 0,04 |
| 21.485 | YUNNAN BAIYAO GROUP CO LTD - A | CNH | 324.568,24 | 0,05 |
| 13.200 | ZHANGZHOU PIENTZEHUANG PHARMACEUTICAL CO LTD - A | CNH | 771.208,26 | 0,11 |
| 23.200 | ZHEJIANG JINGSHENG MECHANICAL & ELECTRICAL CO LTD - A | CNH | 230.628,38 | 0,03 |
| 8.700 | ZHEJIANG SANHUA INTELLIGENT CONTROLS CO LTD | CNH | 30.589,17 | 0,00 |
| 34.900 | ZHEJIANG SUPOR CO LTD - A | CNH | 251.832,34 | 0,04 |
| 76.400 | ZHONGAN ONLINE P&C INSURANCE CO LTD - H | HKD | 313.608,25 | 0,04 |
| 357.800 | ZOOMLION HEAVY INDUSTRY SCIENCE AND TECHNOLOGY CO LTD | HKD | 319.403,14 | 0,05 |
| 140.400 | ZTE CORP | HKD | 460.334,12 | 0,07 |
| 72.700 | 360 SECURITY TECHNOLOGY INC | CNH | 133.421,88 | 0,02 |
| | | | **95.463.463,62** | **13,62** |
| | **Indien** | | | |
| 46.838 | AMBUJA CEMENTS LTD | INR | 251.965,57 | 0,04 |
| 5.797 | APOLLO HOSPITALS ENTERPRISE LTD | INR | 348.680,56 | 0,05 |
| 52.743 | ASIAN PAINTS LTD | INR | 2.301.732,68 | 0,33 |
| 11.620 | AUROBINDO PHARMA LTD | INR | 113.001,72 | 0,02 |
| 25.841 | AVENUE SUPERMARTS LTD | INR | 1.472.381,40 | 0,21 |
| 189.159 | AXIS BANK LTD | INR | 1.949.033,64 | 0,28 |
| 18.903 | BAJAJ AUTO LTD | INR | 973.725,28 | 0,14 |
| 21.586 | BAJAJ FINANCE LTD | INR | 2.224.964,02 | 0,32 |
| 2.153 | BAJAJ FINSERV LTD | INR | 514.821,68 | 0,07 |
| 80.074 | BERGER PAINTS INDIA LTD | INR | 870.283,81 | 0,12 |
| 283.678 | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | INR | 1.643.979,78 | 0,23 |
| 255.681 | BHARTI AIRTEL LTD | INR | 2.360.912,63 | 0,34 |
| 16.430 | BRITANNIA INDUSTRIES LTD | INR | 871.715,97 | 0,12 |
| 6.116 | COLGATE-PALMOLIVE INDIA LTD | INR | 137.601,33 | 0,02 |
| 78.644 | DABUR INDIA LTD | INR | 652.557,36 | 0,09 |
| 99.476 | DLF LTD | INR | 557.312,58 | 0,08 |
| 15.098 | DR REDDY'S LABORATORIES LTD | INR | 990.862,12 | 0,14 |
| 24.881 | EICHER MOTORS LTD | INR | 932.037,38 | 0,13 |
| 58.112 | GODREJ CONSUMER PRODUCTS LTD | INR | 807.098,81 | 0,12 |
| 170.677 | HCL TECHNOLOGIES LTD | INR | 2.934.440,54 | 0,42 |
| 101.809 | HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | INR | 987.333,14 | 0,14 |
| 20.778 | HERO MOTOCORP LTD | INR | 790.801,17 | 0,11 |
| 362.986 | HINDALCO INDUSTRIES LTD | INR | 2.379.304,58 | 0,34 |
| 259.534 | HINDUSTAN PETROLEUM CORP LTD | INR | 1.045.817,39 | 0,15 |
| 113.965 | HINDUSTAN UNILEVER LTD | INR | 4.123.912,38 | 0,59 |
| 150.451 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD | INR | 5.547.250,41 | 0,79 |
| 483.571 | ICICI BANK LTD | INR | 4.559.065,52 | 0,65 |
| 26.386 | ICICI LOMBARD GENERAL INSURANCE CO LTD | INR | 561.218,49 | 0,08 |
| 42.369 | ICICI PRUDENTIAL LIFE INSURANCE CO LTD | INR | 382.435,17 | 0,05 |
| 1.445.554 | INDIAN OIL CORP LTD | INR | 2.430.966,61 | 0,34 |
| 67.986 | INDRAPRASTHA GAS LTD | INR | 487.094,07 | 0,07 |
| 4.989 | INDUS TOWERS LTD | INR | 20.519,13 | 0,00 |
| 3.895 | INFO EDGE INDIA LTD | INR | 336.663,75 | 0,05 |
| 384.344 | INFOSYS LTD | INR | 8.670.426,43 | 1,24 |
| 200.630 | JSW STEEL LTD | INR | 1.800.166,51 | 0,26 |
| 78.624 | KOTAK MAHINDRA BANK LTD | INR | 2.112.153,48 | 0,30 |
| 11.767 | LUPIN LTD | INR | 149.724,76 | 0,02 |
| 106.486 | MAHINDRA & MAHINDRA LTD | INR | 1.151.406,66 | 0,16 |
| 27.040 | MARICO LTD | INR | 198.670,94 | 0,03 |
| 499 | MRF LTD | INR | 532.853,74 | 0,08 |
| 6.478 | MUTHOOT FINANCE LTD | INR | 126.163,67 | 0,02 |
| 5.647 | NESTLE INDIA LTD | INR | 1.473.167,34 | 0,21 |
| 8.053 | PIRAMAL ENTERPRISES LTD | INR | 281.019,97 | 0,04 |
| 461.228 | POWER GRID CORP OF INDIA LTD | INR | 1.173.062,95 | 0,17 |
| 371.501 | RELIANCE INDUSTRIES LTD | INR | 12.534.873,79 | 1,79 |
| 46.274 | SBI LIFE INSURANCE CO LTD | INR | 755.807,09 | 0,11 |
| 2.319 | SHREE CEMENT LTD | INR | 895.714,42 | 0,13 |
| 4.924 | SHRIRAM TRANSPORT FINANCE CO LTD | INR | 85.934,55 | 0,01 |
| 116.510 | STATE BANK OF INDIA | INR | 709.005,62 | 0,10 |
| 100.147 | SUN PHARMACEUTICAL INDUSTRIES LTD | INR | 1.099.679,30 | 0,16 |
| 42.206 | TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | INR | 460.841,58 | 0,07 |
| 266.883 | TATA MOTORS LTD | INR | 1.194.803,73 | 0,17 |
| 134.329 | TATA STEEL LTD | INR | 2.320.337,15 | 0,33 |
| 94.999 | TECH MAHINDRA LTD | INR | 1.763.467,34 | 0,25 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 50.958 | TITAN CO LTD | INR | 1.480.468,59 | 0,21 |
| 264.949 | WIPRO LTD | INR | 2.261.968,31 | 0,32 |
| | | | **89.793.208,59** | **12,81** |
| | **Südkorea** | | | |
| 4.429 | AMOREPACIFIC CORP | KRW | 665.728,85 | 0,09 |
| 12.458 | AMOREPACIFIC GROUP | KRW | 514.565,68 | 0,07 |
| 3.830 | BGF RETAIL CO LTD | KRW | 549.891,03 | 0,08 |
| 8.050 | CELLTRION HEALTHCARE CO LTD | KRW | 741.594,80 | 0,11 |
| 12.377 | CELLTRION INC | KRW | 2.704.619,83 | 0,39 |
| 1.883 | CJ CHEILJEDANG CORP | KRW | 649.318,39 | 0,09 |
| 5.479 | CJ CORP | KRW | 455.839,25 | 0,07 |
| 7.712 | CJ ENM CO LTD | KRW | 983.210,19 | 0,14 |
| 975 | CJ LOGISTICS CORP | KRW | 125.617,32 | 0,02 |
| 14.030 | COWAY CO LTD | KRW | 876.627,42 | 0,13 |
| 7.411 | DONGBU INSURANCE CO LTD | KRW | 396.905,76 | 0,06 |
| 14.724 | DOOSAN BOBCAT INC | KRW | 496.571,52 | 0,07 |
| 2.471 | E-MART INC | KRW | 342.288,35 | 0,05 |
| 12.908 | FILA KOREA LTD | KRW | 463.587,23 | 0,07 |
| 662 | GREEN CROSS CORP/SOUTH KOREA | KRW | 184.797,03 | 0,03 |
| 18.502 | GS ENGINEERING & CONSTRUCTION CORP | KRW | 666.052,21 | 0,10 |
| 47.649 | HANA FINANCIAL GROUP INC | KRW | 1.861.766,65 | 0,27 |
| 35.112 | HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD | KRW | 1.278.777,99 | 0,18 |
| 93.216 | HANON SYSTEMS | KRW | 1.228.452,25 | 0,17 |
| 26.358 | HMM CO LTD | KRW | 747.990,06 | 0,11 |
| 4.940 | HONAM PETROCHEMICAL CORP | KRW | 1.004.610,14 | 0,14 |
| 16.787 | HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | KRW | 726.590,45 | 0,10 |
| 15.876 | HYUNDAI HEAVY INDUSTRIES HOLDINGS CO LTD | KRW | 864.965,62 | 0,12 |
| 12.788 | HYUNDAI MOBIS CO LTD | KRW | 2.724.436,08 | 0,39 |
| 34.530 | HYUNDAI STEEL CO | KRW | 1.376.797,40 | 0,20 |
| 55.643 | INDUSTRIAL BANK OF KOREA | KRW | 491.986,64 | 0,07 |
| 36.666 | KAKAO CORP | KRW | 3.643.334,25 | 0,52 |
| 51.366 | KB FINANCIAL GROUP INC | KRW | 2.391.962,43 | 0,34 |
| 6.074 | KOREA INVESTMENT HOLDINGS CO LTD | KRW | 441.406,84 | 0,06 |
| 11.895 | KOREA SHIPBUILDING & OFFSHORE ENGINEERING CO LTD | KRW | 1.021.687,53 | 0,15 |
| 20.027 | KOREAN AIR LINES CO LTD | KRW | 568.328,29 | 0,08 |
| 6.841 | LG CHEM LTD | KRW | 4.470.280,62 | 0,64 |
| 91.193 | LG DISPLAY CO LTD | KRW | 1.455.205,05 | 0,20 |
| 19.614 | LG ELECTRONICS INC | KRW | 2.105.861,62 | 0,30 |
| 1.735 | LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD | KRW | 1.953.369,31 | 0,28 |
| 303 | LG HOUSEHOLD & HEALTH CARE LTD - PREF | KRW | 163.806,50 | 0,02 |
| 7.011 | LG INNOTEK CO LTD | KRW | 1.230.947,42 | 0,18 |
| 28.019 | LG UPLUS CORP | KRW | 353.913,69 | 0,05 |
| 10.558 | LOTTE SHOPPING CO LTD | KRW | 911.295,02 | 0,13 |
| 66.865 | MIRAE ASSET SECURITIES CO LTD | KRW | 487.607,32 | 0,07 |
| 13.421 | NAVER CORP | KRW | 4.385.004,84 | 0,63 |
| 2.139 | NCSOFT CORP | KRW | 1.086.129,40 | 0,15 |
| 2.610 | NETMARBLE CORP | KRW | 259.343,87 | 0,04 |
| 18.197 | SAMSUNG C&T CORP | KRW | 1.892.431,76 | 0,27 |
| 18.323 | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | KRW | 2.738.724,92 | 0,39 |
| 38.359 | SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | KRW | 825.299,64 | 0,12 |
| 5.677 | SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD | KRW | 1.123.415,03 | 0,16 |
| 138.141 | SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES CO LTD | KRW | 721.220,00 | 0,09 |
| 18.041 | SAMSUNG LIFE INSURANCE CO LTD | KRW | 1.115.090,57 | 0,16 |
| 8.031 | SAMSUNG SDI CO LTD | KRW | 4.855.651,90 | 0,69 |
| 11.310 | SAMSUNG SDS CO LTD | KRW | 1.528.590,36 | 0,22 |
| 7.499 | SAMSUNG SECURITIES CO LTD | KRW | 302.476,99 | 0,04 |
| 68.902 | SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | KRW | 2.344.048,90 | 0,33 |
| 72.415 | SK HYNIX INC | KRW | 6.280.861,75 | 0,90 |
| 13.298 | SK INNOVATION CO LTD | KRW | 2.967.465,49 | 0,42 |
| 5.719 | SK TELECOM CO LTD | KRW | 1.560.337,63 | 0,22 |
| 41.305 | S-OIL CORP | KRW | 3.826.033,66 | 0,55 |
| 33.336 | WOORI FINANCIAL GROUP INC | KRW | 327.033,99 | 0,05 |
| | | | **82.461.754,73** | **11,77** |
| | **Brasilien** | | | |
| 99.100 | ALPARGATAS SA - PREF | BRL | 960.281,89 | 0,14 |
| 82.300 | ATACADAO SA | BRL | 268.246,44 | 0,04 |
| 430.690 | BANCO BRADESCO SA | BRL | 1.411.683,72 | 0,20 |
| 418.120 | BANCO BRADESCO SA - PREF | BRL | 1.598.384,92 | 0,23 |
| 100.900 | BANCO DO BRASIL SA | BRL | 535.155,72 | 0,08 |
| 108.500 | BANCO SANTANDER BRASIL SA | BRL | 704.297,20 | 0,10 |
| 88.100 | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES SA | BRL | 322.559,60 | 0,05 |
| 62.500 | BRASKEM SA -PREF A | BRL | 680.641,96 | 0,10 |
| 101.100 | BRF SA | BRL | 502.633,38 | 0,07 |
| 883.400 | B3 SA - BRASIL BOLSA BALCAO | BRL | 2.065.465,69 | 0,30 |
| 176.500 | CCR SA | BRL | 378.984,75 | 0,05 |
| 416.724 | CIA ENERGETICA DE MINAS GERAIS - PREF | BRL | 1.072.995,17 | 0,15 |
| 723.800 | CIA PARANAENSE DE ENERGIA | BRL | 967.032,61 | 0,14 |
| 266.200 | CPFL ENERGIA SA | BRL | 1.315.635,45 | 0,19 |
| 285.800 | HAPVIDA PARTICIPACOES E INVESTIMENTOS | BRL | 712.808,46 | 0,10 |
| 96.000 | HYPERA SA | BRL | 566.250,07 | 0,08 |
| 602.100 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA - PREF | BRL | 3.196.746,68 | 0,46 |
| 196.800 | KLABIN SA | BRL | 874.401,81 | 0,12 |
| 114.200 | LOCALIZA RENT A CAR SA | BRL | 1.141.601,79 | 0,16 |
| 166.500 | LOJAS RENNER SA | BRL | 1.051.759,07 | 0,15 |
| 589.400 | MAGAZINE LUIZA SA | BRL | 1.551.138,03 | 0,22 |
| 145.300 | NATURA &CO HOLDING SA | BRL | 1.215.166,55 | 0,17 |
| 171.100 | RAIA DROGASIL SA | BRL | 733.837,47 | 0,10 |
| 70.800 | REDE D'OR SAO LUIZ SA | BRL | 882.385,07 | 0,13 |
| 138.700 | RUMO SA | BRL | 427.384,06 | 0,06 |
| 125.000 | SUZANO SA | BRL | 1.250.711,15 | 0,18 |
| 66.600 | TELEFONICA BRASIL SA | BRL | 523.985,02 | 0,07 |
| 163.400 | TOTVS SA | BRL | 1.082.556,11 | 0,15 |
| 594.000 | ULTRAPAR PARTICIPACOES SA | BRL | 1.606.849,09 | 0,23 |
| 230.900 | VIA S/A | BRL | 326.715,30 | 0,05 |
| 317.900 | WEG SA | BRL | 2.312.095,47 | 0,33 |
| | | | **32.240.389,70** | **4,60** |
| | **Russland** | | | |
| 1.726.420 | ALROSA PJSC | USD | 3.155.160,31 | 0,45 |
| 29.044.500 | INTER RAO UES PJSC | USD | 1.854.375,15 | 0,26 |
| 65.248 | MAGNIT PJSC | USD | 1.099.428,80 | 0,16 |
| 71.800 | MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR | USD | 692.152,00 | 0,10 |
| 304.370 | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC | USD | 727.335,03 | 0,10 |
| 1.201.160 | NOVOLIPETSK STEEL PJSC | USD | 3.580.458,57 | 0,51 |
| 1.646.710 | SBERBANK OF RUSSIA PJSC | USD | 7.710.362,24 | 1,10 |
| 178.197 | SEVERSTAL PAO | USD | 3.720.873,82 | 0,53 |
| 1.610.210.000 | VTB BANK PJSC | USD | 1.146.469,52 | 0,17 |
| | | | **23.686.615,44** | **3,38** |
| | **Südafrika** | | | |
| 50.951 | ABSA GROUP LTD | ZAR | 517.028,19 | 0,07 |
| 59.787 | ASPEN PHARMACARE HOLDINGS LTD | ZAR | 1.076.642,87 | 0,15 |
| 65.455 | BID CORP LTD | ZAR | 1.403.551,85 | 0,20 |
| 49.303 | BIDVEST GROUP LTD/THE | ZAR | 642.298,97 | 0,09 |
| 10.202 | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | ZAR | 1.233.529,96 | 0,18 |
| 16.765 | CLICKS GROUP LTD | ZAR | 309.447,69 | 0,04 |
| 83.192 | DISCOVERY LTD | ZAR | 756.884,08 | 0,11 |
| 647.520 | FIRSTRAND LTD | ZAR | 2.776.438,36 | 0,40 |
| 743.291 | GROWTHPOINT PROPERTIES LTD | ZAR | 706.484,63 | 0,10 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 176.033 | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | ZAR | 2.008.613,17 | 0,29 |
| 3.283 | MULTICHOICE GROUP | ZAR | 24.913,27 | 0,00 |
| 44.592 | NEDBANK GROUP LTD | ZAR | 518.861,78 | 0,07 |
| 149.017 | NORTHAM PLATINUM HOLDINGS LTD | ZAR | 1.776.120,20 | 0,25 |
| 937.060 | OLD MUTUAL LTD | ZAR | 1.032.042,82 | 0,15 |
| 43.015 | RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD | ZAR | 107.501,76 | 0,02 |
| 20.614 | REMGRO LTD | ZAR | 186.135,72 | 0,03 |
| 291.831 | SANLAM LTD | ZAR | 1.239.869,56 | 0,18 |
| 80.272 | SASOL LTD | ZAR | 1.522.900,43 | 0,22 |
| 188.290 | STANDARD BANK GROUP LTD | ZAR | 1.791.915,07 | 0,26 |
| 128.040 | VODACOM GROUP LTD | ZAR | 1.225.847,90 | 0,17 |
| | | | **20.857.028,28** | **2,98** |
| | **Mexiko** | | | |
| 3.556.500 | AMERICA MOVIL SAB DE CV | MXN | 3.162.756,70 | 0,44 |
| 66.900 | ARCA CONTINENTAL SAB DE CV | MXN | 409.257,56 | 0,06 |
| 2.544.600 | CEMEX SAB DE CV | MXN | 1.846.722,29 | 0,25 |
| 108.000 | FIBRA UNO ADMINISTRACION SA DE CV | MXN | 123.484,14 | 0,02 |
| 210.700 | FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV | MXN | 1.836.503,64 | 0,26 |
| 48.200 | GRUPO AEROPORTUARIO DEL PACIFICO SAB DE CV | MXN | 563.070,41 | 0,08 |
| 28.350 | GRUPO AEROPORTUARIO DEL SURESTE SAB DE CV - B | MXN | 531.342,57 | 0,08 |
| 60.500 | GRUPO CARSO SAB DE CV | MXN | 210.407,90 | 0,03 |
| 249.100 | GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV | MXN | 1.604.002,97 | 0,23 |
| 148.000 | GRUPO TELEVISA SAB | MXN | 327.199,98 | 0,05 |
| 39.400 | INDUSTRIAS PENOLES SAB DE CV | MXN | 467.499,23 | 0,07 |
| 342.700 | ORBIA ADVANCE CORP SAB DE CV | MXN | 883.918,96 | 0,13 |
| 713.000 | WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | MXN | 2.427.625,40 | 0,35 |
| | | | **14.393.791,75** | **2,05** |
| | **Thailand** | | | |
| 120.100 | ADVANCED INFO SERVICE PCL | THB | 693.646,30 | 0,10 |
| 892.900 | AIRPORTS OF THAILAND PCL | THB | 1.604.987,50 | 0,23 |
| 5.048.800 | ASSET WORLD CORP PCL | THB | 693.287,01 | 0,11 |
| 1.379.900 | BANGKOK DUSIT MEDICAL SERVICES PCL | THB | 927.089,05 | 0,13 |
| 68.600 | BERLI JUCKER PCL | THB | 66.707,87 | 0,01 |
| 593.800 | BTS GROUP HOLDINGS PCL | THB | 164.477,70 | 0,02 |
| 797.500 | CENTRAL RETAIL CORP PCL | THB | 787.253,32 | 0,11 |
| 856.500 | CP ALL PCL | THB | 1.602.655,18 | 0,23 |
| 55.500 | DELTA ELECTRONICS THAI | THB | 768.652,13 | 0,11 |
| 444.500 | ENERGY ABSOLUTE PCL | THB | 802.263,17 | 0,11 |
| 1.571.200 | HOME PRODUCT CENTER PCL | THB | 629.664,75 | 0,09 |
| 540.700 | INDORAMA VENTURES PCL | THB | 709.014,93 | 0,10 |
| 93.700 | INTOUCH HOLDINGS PCL | THB | 222.266,74 | 0,03 |
| 80.500 | KRUNGTHAI CARD PCL | THB | 129.873,04 | 0,02 |
| 104.400 | KRUNGTHAI CARD PCL | THB | 168.431,62 | 0,02 |
| 1.803.400 | LAND & HOUSES PCL | THB | 422.472,26 | 0,06 |
| 803.258 | MINOR INTERNATIONAL PCL | THB | 745.597,80 | 0,11 |
| 85.300 | OSOTSPA PCL | THB | 85.460,80 | 0,01 |
| 155.200 | SIAM CEMENT PCL/THE - REG | THB | 1.838.470,93 | 0,26 |
| 75.000 | SIAM COMMERCIAL BANK PCL/THE | THB | 269.624,96 | 0,04 |
| 219.200 | THAI UNION GROUP PCL | THB | 140.164,90 | 0,02 |
| | | | **13.472.061,96** | **1,92** |
| | **Polen** | | | |
| 6.858 | BANK POLSKA KASA OPIEKI SA | PLN | 177.958,30 | 0,03 |
| 1.415 | CD PROJEKT SA | PLN | 68.340,45 | 0,01 |
| 60.335 | KGHM POLSKA MIEDZ SA | PLN | 2.395.168,46 | 0,34 |
| 278 | LPP SA | PLN | 1.036.046,58 | 0,15 |
| 141.643 | POLSKI KONCERN NAFTOWY ORLEN SA | PLN | 2.925.416,14 | 0,42 |
| 1.684.684 | POLSKIE GORNICTWO NAFTOWE I GAZOWNICTWO SA | PLN | 2.742.158,61 | 0,38 |
| 39.601 | POWSZECHNA KASA OSZCZEDNOSCI BANK POLSKI SA | PLN | 421.214,04 | 0,06 |
| | | | **9.766.302,58** | **1,39** |
| | **Indonesien** | | | |
| 1.352.300 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | IDR | 3.297.089,75 | 0,47 |
| 1.531.300 | BANK MANDIRI PERSERO TBK PT | IDR | 656.032,08 | 0,09 |
| 350.600 | BANK NEGARA INDONESIA PERSERO TBK PT | IDR | 131.274,40 | 0,02 |
| 7.728.159 | BANK RAKYAT INDONESIA PERSERO TBK PT | IDR | 2.072.652,31 | 0,30 |
| 9.068.500 | BARITO PACIFIC TBK PT | IDR | 609.610,51 | 0,10 |
| 2.218.600 | KALBE FARMA TBK PT | IDR | 221.006,34 | 0,03 |
| 671.100 | SEMEN INDONESIA PERSERO TBK PT | IDR | 383.345,85 | 0,05 |
| 5.839.600 | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT | IDR | 1.501.063,77 | 0,21 |
| 827.500 | UNILEVER INDONESIA TBK PT | IDR | 227.695,67 | 0,03 |
| | | | **9.099.770,68** | **1,30** |
| | **Malaysia** | | | |
| 128.600 | CIMB GROUP HOLDINGS BHD | MYR | 146.393,89 | 0,02 |
| 5.341.000 | DIALOG GROUP BHD | MYR | 3.040.006,88 | 0,44 |
| 160.700 | DIGI.COM BHD | MYR | 170.306,00 | 0,02 |
| 42.400 | FRASER & NEAVE HOLDINGS BHD | MYR | 269.607,02 | 0,04 |
| 199.500 | HAP SENG CONSOLIDATED BHD | MYR | 377.714,90 | 0,05 |
| 161.500 | HARTALEGA HOLDINGS BHD | MYR | 236.538,42 | 0,03 |
| 37.700 | HONG LEONG BANK BHD | MYR | 169.690,39 | 0,02 |
| 151.300 | IHH HEALTHCARE BHD | MYR | 241.416,98 | 0,03 |
| 696.200 | IOI CORP BHD | MYR | 625.071,19 | 0,10 |
| 302.708 | MALAYAN BANKING BHD | MYR | 580.328,44 | 0,08 |
| 246.300 | MAXIS BHD | MYR | 275.100,48 | 0,04 |
| 13.900 | NESTLE MALAYSIA BHD | MYR | 440.602,48 | 0,06 |
| 1.624.900 | PUBLIC BANK BHD | MYR | 1.574.980,46 | 0,23 |
| 167.844 | SUPERMAX CORP BHD | MYR | 95.533,97 | 0,01 |
| 79.400 | TELEKOM MALAYSIA BHD | MYR | 107.782,79 | 0,02 |
| | | | **8.351.074,29** | **1,19** |
| | **Vereinigte Arabische Emirate** | | | |
| 206.795 | ABU DHABI COMMERCIAL BANK PJSC | AED | 421.680,18 | 0,06 |
| 642.862 | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC | AED | 728.068,80 | 0,10 |
| 434.656 | ALDAR PROPERTIES PJSC | AED | 482.799,91 | 0,07 |
| 652.593 | EMAAR PROPERTIES PJSC | AED | 724.876,32 | 0,11 |
| 467.866 | EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC | AED | 3.059.537,81 | 0,44 |
| 440.778 | FIRST ABU DHABI BANK PJSC | AED | 2.133.600,00 | 0,30 |
| | | | **7.550.563,02** | **1,08** |
| | **Hongkong** | | | |
| 180.000 | CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTERNATIONAL CO LTD | HKD | 307.995,97 | 0,04 |
| 254.500 | CHINA OVERSEAS LAND & INVESTMENT LTD | HKD | 578.239,14 | 0,08 |
| 463.500 | CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD | HKD | 227.360,28 | 0,03 |
| 169.200 | CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS CO LTD | HKD | 256.577,24 | 0,04 |
| 408.000 | CHINA TRADITIONAL CHINESE MEDICINE HOLDINGS CO LTD | HKD | 206.406,50 | 0,03 |
| 1.260.880 | CSPC PHARMACEUTICAL GROUP LTD | HKD | 1.508.296,51 | 0,22 |
| 420.000 | FOSUN INTERNATIONAL LTD | HKD | 509.407,53 | 0,07 |
| 1.222.000 | LENOVO GROUP LTD | HKD | 1.309.974,30 | 0,19 |
| 594.000 | SHENZHEN INVESTMENT LTD | HKD | 149.110,62 | 0,02 |
| 127.500 | SINOTRUK HONG KONG LTD | HKD | 189.423,68 | 0,03 |
| 303.000 | WHARF HOLDINGS LTD/THE | HKD | 1.003.157,83 | 0,14 |
| | | | **6.245.949,60** | **0,89** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Katar** | | | |
| 199.881 | OOREDOO QPSC | QAR | 402.891,15 | 0,06 |
| 373.498 | QATAR FUEL QSC | QAR | 1.840.305,99 | 0,26 |
| 507.916 | QATAR NATIONAL BANK QPSC | QAR | 2.671.406,59 | 0,38 |
| | | | **4.914.603,73** | **0,70** |
| | **Chile** | | | |
| 203.046 | EMPRESAS CMPC SA | CLP | 381.992,47 | 0,05 |
| 378.755 | EMPRESAS COPEC SA | CLP | 3.138.415,60 | 0,45 |
| 7.405.968 | ENEL AMERICAS SA | CLP | 874.819,71 | 0,13 |
| 4.832.612 | ENEL CHILE SA | CLP | 228.481,04 | 0,03 |
| 47.710 | FALABELLA SA | CLP | 166.826,40 | 0,02 |
| | | | **4.790.535,22** | **0,68** |
| | **Kuwait** | | | |
| 349.414 | AGILITY PUBLIC WAREHOUSING CO KSC | KWD | 1.141.156,47 | 0,16 |
| 827.821 | KUWAIT FINANCE HOUSE | KWD | 2.256.196,49 | 0,32 |
| 555.018 | MOBILE TELECOMMUNICATIONS CO KSC | KWD | 1.102.306,97 | 0,16 |
| | | | **4.499.659,93** | **0,64** |
| | **Bermuda** | | | |
| 566.000 | ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LTD | HKD | 811.896,29 | 0,12 |
| 1.226.000 | BEIJING ENTERPRISES WATER GROUP LTD | HKD | 480.482,89 | 0,07 |
| 698.000 | BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE HOLDINGS LTD | HKD | 652.595,95 | 0,09 |
| 246.000 | CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | HKD | 1.288.618,92 | 0,18 |
| 2.204.000 | CHINA YOUZAN LTD | HKD | 276.632,98 | 0,04 |
| 4.600 | CREDICORP LTD | USD | 510.324,00 | 0,07 |
| 2.655.000 | GOME RETAIL HOLDINGS LTD | HKD | 248.229,62 | 0,04 |
| 101.392 | SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 130.118,03 | 0,02 |
| | | | **4.398.898,68** | **0,63** |
| | **Philippinen** | | | |
| 60.950 | AYALA CORP | PHP | 973.297,53 | 0,14 |
| 1.500.690 | AYALA LAND INC | PHP | 982.620,13 | 0,15 |
| 261.740 | BANK OF THE PHILIPPINE ISLANDS | PHP | 416.688,04 | 0,06 |
| 306.680 | BDO UNIBANK INC | PHP | 662.964,75 | 0,09 |
| 190.890 | INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SERVICES INC | PHP | 727.558,04 | 0,10 |
| 158.550 | UNIVERSAL ROBINA CORP | PHP | 421.148,79 | 0,06 |
| | | | **4.184.277,28** | **0,60** |
| | **Türkei** | | | |
| 81.908 | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | TRY | 589.123,58 | 0,08 |
| 46.083 | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | TRY | 866.755,13 | 0,12 |
| 258.179 | KOC HOLDING AS | TRY | 657.344,06 | 0,10 |
| 248.278 | TURKCELL ILETISIM HIZMETLERI AS | TRY | 428.410,02 | 0,06 |
| 128.755 | TURKIYE SISE VE CAM FABRIKALARI AS | TRY | 118.693,58 | 0,02 |
| | | | **2.660.326,37** | **0,38** |
| | **Kolumbien** | | | |
| 49.780 | BANCOLOMBIA SA | COP | 430.424,69 | 0,06 |
| 92.003 | BANCOLOMBIA SA - PREF | COP | 796.472,92 | 0,11 |
| 216.881 | INTERCONEXION ELECTRICA SA ESP | COP | 1.291.523,90 | 0,19 |
| | | | **2.518.421,51** | **0,36** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 35.275 | ALLEGRO.EU SA | PLN | 513.858,04 | 0,07 |
| 6.900 | GLOBANT SA | USD | 1.938.969,00 | 0,28 |
| | | | **2.452.827,04** | **0,35** |
| | **Griechenland** | | | |
| 225.770 | ALPHA SERVICES AND HOLDINGS SA | EUR | 286.513,47 | 0,04 |
| 500.641 | EUROBANK ERGASIAS SERVICES AND HOLDINGS SA | EUR | 469.976,48 | 0,07 |
| 41.085 | HELLENIC TELECOMMUNICATIONS ORGANIZATION SA | EUR | 772.322,76 | 0,11 |
| | | | **1.528.812,71** | **0,22** |
| | **Niederlande** | | | |
| 35.777 | X5 RETAIL GROUP NV - GDR REG | USD | 1.161.679,19 | 0,17 |
| | | | **1.161.679,19** | **0,17** |
| | **Ungarn** | | | |
| 11.912 | OTP BANK NYRT | HUF | 699.465,54 | 0,10 |
| 13.790 | RICHTER GEDEON NYRT | HUF | 377.508,18 | 0,05 |
| | | | **1.076.973,72** | **0,15** |
| | **Ägypten** | | | |
| 276.010 | COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE | EGP | 749.019,50 | 0,11 |
| | | | **749.019,50** | **0,11** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 16.195 | KOMERCNI BANKA AS | CZK | 656.548,05 | 0,10 |
| | | | **656.548,05** | **0,10** |
| | **Insel Man** | | | |
| 90.076 | NEPI ROCKCASTLE PLC | ZAR | 625.891,99 | 0,09 |
| | | | **625.891,99** | **0,09** |
| | **Singapur** | | | |
| 65.200 | BOC AVIATION LTD | HKD | 544.454,11 | 0,08 |
| | | | **544.454,11** | **0,08** |
| | | | **697.820.588,12** | **99,58** |
| | **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | |
| | **Indien** | | | |
| 397.213 | BRITANNIA INDUSTRIES LTD 5.500% 03/06/2024 | INR | 1.556,67 | 0,00 |
| | | | **1.556,67** | **0,00** |
| | | | **1.556,67** | **0,00** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **697.822.144,79** | **99,58** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 225,22 | USD | 1.458,00 | CNH | 08/10/2021 | 225,22 | (0,62) |
| 1.889,03 | EUR | 2.241,37 | USD | 19/10/2021 | 2.241,37 | (51,43) |
| 143.735.430,66 | PLN | 37.809.500,25 | USD | 19/10/2021 | 37.809.500,25 | (1.616.309,32) |
| | | | | | **37.811.966,84** | **(1.616.361,37)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD |
|---|---|---|---|
| | **Bezugsrechte** | | |
| 45.730 | SAMSUNG HEAVY INDUSTRIES RIGHTS 31/12/2049 | KRW | 41.326,94 |
| 18.262 | BHARTI AIRTEL LTD RIGHTS 21/10/2021 | INR | 37.603,72 |
| 210 | HYUNDAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION CO LTD RIGHTS 22/10/2021 | KRW | 14.182,32 |
| | | | **93.112,98** |
| | **Optionsscheine** | | |
| 29.690 | BTS GROUP HOLDINGS PCL 05/09/2022 | THB | 1.469,80 |
| 118.760 | BTS GROUP HOLDINGS PCL 31/12/2026 | THB | 0,00 |
| 59.380 | BTS GROUP HOLDINGS PCL 31/12/2024 | THB | 0,00 |
| | | | **1.469,80** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | **(1.521.778,59)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **697.822.144,79** | **99,58** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(1.521.778,59)** | **(0,22)** |
| **Bankguthaben** | **2.149.939,63** | **0,31** |
| **Bankverbindlichkeiten** | **(1.137,01)** | **0,00** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **2.332.186,52** | **0,33** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **700.781.355,34** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 189.300.228,00 |
| | 30.09.2020 | EUR | 205.342.749,48 |
| | 30.09.2019 | EUR | 459.590.128,09 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 8.132,66 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.058,70 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.760,61 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 83,60 |
| | 30.09.2020 | USD | 73,42 |
| | 30.09.2019 | USD | 65,38 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 190.540,91 |
| | 30.09.2020 | CZK | 164.954,78 |
| | 30.09.2019 | CZK | 158.318,95 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 34.509,03 |
| | 30.09.2020 | PLN | 29.874,25 |
| | 30.09.2019 | PLN | 28.423,22 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 339,91 |
| | 30.09.2020 | EUR | 295,59 |
| | 30.09.2019 | EUR | 283,64 |
| Capitalisation N (USD) | 30.09.2021 | USD | 126,60 |
| | 30.09.2020 | USD | 111,39 |
| | 30.09.2019 | USD | 99,37 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 318,04 |
| | 30.09.2020 | EUR | 278,92 |
| | 30.09.2019 | EUR | 269,92 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 118,40 |
| | 30.09.2020 | USD | 105,06 |
| | 30.09.2019 | USD | 94,53 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 283,52 |
| | 30.09.2020 | EUR | 246,79 |
| | 30.09.2019 | EUR | 237,06 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.186,87 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.046,13 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.017,46 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 65,41 |
| | 30.09.2020 | USD | 58,33 |
| | 30.09.2019 | USD | 52,75 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 1.284,45 |
| | 30.09.2020 | CZK | 1.129,00 |
| | 30.09.2019 | CZK | 1.100,52 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 263,89 |
| | 30.09.2020 | USD | 237,70 |
| | 30.09.2019 | USD | 217,10 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.316,38 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.296,11 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.978,53 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 944,23 |
| | 30.09.2020 | EUR | 843,36 |
| | 30.09.2019 | EUR | 838,01 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 867,74 |
| | 30.09.2020 | EUR | 781,80 |
| | 30.09.2019 | EUR | 783,62 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 257,15 |
| | 30.09.2020 | EUR | 229,92 |
| | 30.09.2019 | EUR | 228,69 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 236,34 |
| | 30.09.2020 | USD | 217,56 |
| | 30.09.2019 | USD | 204,75 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 227,50 |
| | 30.09.2020 | USD | 211,75 |
| | 30.09.2019 | USD | 201,37 |

| **Anzahl der Anteile** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 4.052 |
| | 30.09.2020 | 6.310 |
| | 30.09.2019 | 9.083 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 242.074 |
| | 30.09.2020 | 270.854 |
| | 30.09.2019 | 302.595 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 1.158 |
| | 30.09.2020 | 1.158 |
| | 30.09.2019 | 1.158 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 2.308 |
| | 30.09.2020 | 1.637 |
| | 30.09.2019 | 1.970 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 208.469 |
| | 30.09.2020 | 252.785 |
| | 30.09.2019 | 228.506 |
| Capitalisation N (USD) | 30.09.2021 | 2.037 |
| | 30.09.2020 | 2.823 |
| | 30.09.2019 | 2.772 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 19.661 |
| | 30.09.2020 | 20.756 |
| | 30.09.2019 | 21.908 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 152.032 |
| | 30.09.2020 | 173.640 |
| | 30.09.2019 | 195.594 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 92 |
| | 30.09.2020 | 184 |
| | 30.09.2019 | 184 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 1.328 |
| | 30.09.2020 | 669 |
| | 30.09.2019 | 4.166 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 19.899 |
| | 30.09.2020 | 26.952 |
| | 30.09.2019 | 33.779 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 83.129 |
| | 30.09.2020 | 106.188 |
| | 30.09.2019 | 121.726 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 7.383 |
| | 30.09.2020 | 680 |
| | 30.09.2019 | 767 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 743 |
| | 30.09.2020 | 2.967 |
| | 30.09.2019 | 43.016 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 1.625 |
| | 30.09.2020 | 1.412 |
| | 30.09.2019 | 1.328 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 4.874 |
| | 30.09.2020 | 3.672 |
| | 30.09.2019 | 2.904 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 173 |
| | 30.09.2020 | 330 |
| | 30.09.2019 | 330 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 531 |
| | 30.09.2020 | 263 |
| | 30.09.2019 | 501 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 164 |
| | 30.09.2020 | 859 |
| | 30.09.2019 | 1.096 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution N (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 24,50 |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 22,85 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 6,70 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 08.04.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,68 |
| Distribution X (M) (USD) | 06.10.2020 | USD | 0,68 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 08.04.2021 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,67 |
| Distribution Y (M) (USD) | 06.10.2020 | USD | 0,67 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| **Laufende Kosten in %*** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,86% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,86% |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation N (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,90% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,90% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,15% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,40% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,40% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,42% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 3,40% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 0,01% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,90% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1,15% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,40% |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 3,39% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 191,00% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Emerging Markets High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **187.920.885,90** |
| Aktien | | 187.917.973,41 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 2.912,49 |
| **Bankguthaben** | | **1.058.025,48** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **1.027.444,94** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***190.006.356,32*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(367.567,34)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(338.560,98)** |
| Devisentermingeschäfte | | (338.560,98) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(706.128,32)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***189.300.228,00*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **4.600.514,90** |
| Dividenden | | 4.597.126,66 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 3.388,24 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(2.302.704,08)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.591.612,16) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (623.643,49) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (6.014,25) |
| Abonnementsteuer | 9 | (66.380,07) |
| Bankzinsen | | (10.105,78) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (4.948,33) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **2.297.810,82** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 57.642.232,03 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (25.089.559,75) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 237.793,95 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (91.419,06) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 2.503.502,51 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (2.621.461,39) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (3.120.132,70) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 390.705,49 |
| **Ergebnis** | | **32.149.471,90** |
| Zeichnungen | | 43.168.284,65 |
| Rücknahmen | | (91.216.372,63) |
| Ausschüttung | | (143.905,40) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 205.342.749,48 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***189.300.228,00*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Kaimaninseln** | | | | |
| 50.168 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR | USD | 6.408.708,23 | 3,39 |
| 172.300 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | HKD | 2.795.198,89 | 1,48 |
| 313.000 | CHINA AOYUAN GROUP LTD | HKD | 142.163,33 | 0,08 |
| 554.000 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD | HKD | 613.449,55 | 0,31 |
| 54.900 | CHINA LESSO GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 75.716,11 | 0,04 |
| 321.000 | CHINA MEDICAL SYSTEM HOLDINGS LTD | HKD | 503.726,47 | 0,27 |
| 140.400 | CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD | HKD | 606.659,84 | 0,32 |
| 316.000 | CHINA STATE CONSTRUCTION INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 238.162,21 | 0,13 |
| 354.000 | CHINA YUHUA EDUCATION CORP LTD | HKD | 147.875,58 | 0,07 |
| 135.000 | HAITIAN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 358.798,18 | 0,19 |
| 17.500 | INNOVENT BIOLOGICS INC | HKD | 146.011,27 | 0,08 |
| 68.200 | JD.COM INC ADR | USD | 4.251.061,74 | 2,25 |
| 177.000 | JIUMAOJIU INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 460.644,16 | 0,24 |
| 14.700 | JOYY INC ADR | USD | 695.457,96 | 0,37 |
| 55.200 | KUAISHOU TECHNOLOGY - B | HKD | 504.482,34 | 0,27 |
| 148.000 | LEE & MAN PAPER MANUFACTURING LTD | HKD | 93.716,86 | 0,05 |
| 56.000 | LI AUTO INC - ADR | USD | 1.270.322,27 | 0,67 |
| 75.000 | LI NING CO LTD | HKD | 747.185,40 | 0,39 |
| 19.316 | MEITUAN - B | HKD | 526.394,88 | 0,28 |
| 52.100 | NETEASE INC ADR | USD | 3.839.112,99 | 2,03 |
| 68.300 | NIO INC ADR | USD | 2.099.770,48 | 1,11 |
| 9.000 | SILERGY CORP | TWD | 1.140.794,02 | 0,60 |
| 61.300 | SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | HKD | 1.387.368,44 | 0,73 |
| 162.400 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 8.280.660,87 | 4,37 |
| 69.500 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | HKD | 971.575,86 | 0,51 |
| 31.800 | XIAOMI CORP - B | HKD | 75.028,52 | 0,04 |
| 39.200 | XPENG INC - ADR | USD | 1.202.095,00 | 0,64 |
| 18.500 | ZAI LAB LTD ADR | USD | 1.682.311,58 | 0,89 |
| | | | **41.264.453,03** | **21,80** |
| **Taiwan** | | | | |
| 126.600 | ACCTON TECHNOLOGY CORP | TWD | 1.028.113,40 | 0,54 |
| 286.000 | CATHAY FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 511.323,99 | 0,27 |
| 160.680 | CHINA LIFE INSURANCE CO LTD/TAIWAN | TWD | 143.883,63 | 0,08 |
| 2.453.000 | CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 1.734.541,13 | 0,92 |
| 14.000 | ECLAT TEXTILE CO LTD | TWD | 262.402,70 | 0,14 |
| 295.100 | EVERGREEN MARINE CORP TAIWAN LTD | TWD | 1.148.130,68 | 0,61 |
| 63.000 | FORMOSA PETROCHEMICAL CORP | TWD | 192.976,22 | 0,10 |
| 75.650 | HIGHWEALTH CONSTRUCTION CORP | TWD | 105.350,61 | 0,06 |
| 119.400 | MEDIATEK INC | TWD | 3.336.602,51 | 1,76 |
| 57.000 | MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 56.409,79 | 0,03 |
| 11.000 | NOVATEK MICROELECTRONICS CORP | TWD | 139.260,55 | 0,07 |
| 20.400 | PHISON ELECTRONICS CORP | TWD | 237.477,84 | 0,13 |
| 110.000 | REALTEK SEMICONDUCTOR CORP | TWD | 1.683.014,70 | 0,89 |
| 223.000 | TAIWAN MOBILE CO LTD | TWD | 681.008,80 | 0,36 |
| 694.647 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 12.440.668,67 | 6,57 |
| 13.500 | WAN HAI LINES LTD | TWD | 84.830,05 | 0,04 |
| 20.000 | WIWYNN CORP | TWD | 537.280,17 | 0,28 |
| 297.500 | YANG MING MARINE TRANSPORT CORP | TWD | 1.097.757,58 | 0,58 |
| | | | **25.421.033,02** | **13,43** |
| **Indien** | | | | |
| 55.000 | ADANI GREEN ENERGY LTD | INR | 729.803,40 | 0,39 |
| 25.200 | ADANI TOTAL GAS LTD | INR | 413.706,90 | 0,22 |
| 84.884 | ASIAN PAINTS LTD | INR | 3.196.326,88 | 1,69 |
| 32.200 | AUROBINDO PHARMA LTD | INR | 270.190,50 | 0,14 |
| 17.500 | BAJAJ AUTO LTD | INR | 777.819,91 | 0,41 |
| 1.500 | BAJAJ FINSERV LTD | INR | 309.484,82 | 0,16 |
| 50.656 | BERGER PAINTS INDIA LTD | INR | 475.045,90 | 0,25 |
| 148.500 | BHARAT PETROLEUM CORP LTD | INR | 742.561,74 | 0,39 |
| 27.800 | BRITANNIA INDUSTRIES LTD | INR | 1.272.675,05 | 0,67 |
| 79.900 | CIPLA LTD/INDIA | INR | 910.513,47 | 0,48 |
| 32.300 | EICHER MOTORS LTD | INR | 1.044.006,78 | 0,55 |
| 55.200 | HAVELLS INDIA LTD | INR | 880.752,79 | 0,47 |
| 13.400 | HDFC ASSET MANAGEMENT CO LTD | INR | 451.777,04 | 0,24 |
| 203.800 | HDFC LIFE INSURANCE CO LTD | INR | 1.705.363,71 | 0,90 |
| 17.600 | IPCA LABORATORIES LTD | INR | 494.621,72 | 0,26 |
| 128.700 | MAHINDRA & MAHINDRA LTD | INR | 1.200.743,01 | 0,63 |
| 28.200 | MUTHOOT FINANCE LTD | INR | 473.890,25 | 0,25 |
| 3.216 | NESTLE INDIA LTD | INR | 723.911,76 | 0,38 |
| 199.300 | PETRONET LNG LTD | INR | 551.591,11 | 0,29 |
| 36.241 | PIDILITE INDUSTRIES LTD | INR | 1.003.441,28 | 0,53 |
| 2.700 | SHREE CEMENT LTD | INR | 899.845,35 | 0,48 |
| 11.300 | TATA CONSUMER PRODUCTS LTD | INR | 106.461,16 | 0,06 |
| 180.700 | TATA STEEL LTD | INR | 2.693.238,17 | 1,42 |
| 4.500 | TORRENT PHARMACEUTICALS LTD | INR | 160.321,59 | 0,08 |
| 68.100 | UNITED SPIRITS LTD | INR | 673.558,61 | 0,36 |
| 242.600 | WIPRO LTD | INR | 1.787.106,05 | 0,95 |
| | | | **23.948.758,95** | **12,65** |
| **Südkorea** | | | | |
| 2.500 | CJ ENM CO LTD | KRW | 275.013,88 | 0,15 |
| 1.900 | CJ LOGISTICS CORP | KRW | 211.219,38 | 0,11 |
| 14.000 | COWAY CO LTD | KRW | 754.780,49 | 0,40 |
| 1.162 | DL E&C CO LTD | KRW | 113.135,70 | 0,06 |
| 2.200 | DOUZONE BIZON CO LTD | KRW | 153.615,41 | 0,08 |
| 12.300 | GS HOLDINGS | KRW | 399.932,67 | 0,21 |
| 18.700 | HANKOOK TIRE & TECHNOLOGY CO LTD | KRW | 587.646,90 | 0,31 |
| 36.200 | HMM CO LTD | KRW | 886.394,80 | 0,47 |
| 7.900 | HOTEL SHILLA CO LTD | KRW | 497.088,49 | 0,26 |
| 18.900 | HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | KRW | 705.852,00 | 0,37 |
| 4.700 | HYUNDAI GLOVIS CO LTD | KRW | 568.592,10 | 0,30 |
| 64.000 | INDUSTRIAL BANK OF KOREA | KRW | 488.267,71 | 0,26 |
| 2.119 | KOREA ZINC CO LTD | KRW | 774.439,81 | 0,41 |
| 76.400 | MERITZ SECURITIES CO LTD | KRW | 274.781,37 | 0,15 |
| 5.100 | NAVER CORP | KRW | 1.437.774,01 | 0,76 |
| 6.300 | ORION CORP/REPUBLIC OF KOREA | KRW | 537.857,39 | 0,28 |
| 11.200 | POSCO | KRW | 2.685.472,38 | 1,42 |
| 9.300 | SAMSUNG ELECTRO-MECHANICS CO LTD | KRW | 1.199.416,54 | 0,63 |
| 156.066 | SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD | KRW | 8.402.629,89 | 4,44 |
| 38.832 | SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | KRW | 720.890,65 | 0,38 |
| 15.700 | SAMSUNG SECURITIES CO LTD | KRW | 546.416,61 | 0,29 |
| 9.600 | SEEGENE INC | KRW | 423.397,85 | 0,22 |
| 2.000 | SK CHEMICALS CO LTD | KRW | 412.702,47 | 0,22 |
| 4.700 | S-1 CORP | KRW | 285.491,29 | 0,15 |
| 12.370 | YUHAN CORP | KRW | 552.756,10 | 0,29 |
| | | | **23.895.565,89** | **12,62** |
| **China** | | | | |
| 2.212.900 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD -H | HKD | 655.387,31 | 0,35 |
| 232.000 | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD - H | HKD | 1.076.808,96 | 0,57 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 656.000 | CHINA COMMUNICATIONS SERVICES CORP LTD - H | HKD | 313.176,33 | 0,17 |
| 7.235.800 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP - H | HKD | 4.461.923,41 | 2,35 |
| 1.077.000 | CHINA MOLYBDENUM CO LTD - H | HKD | 577.243,25 | 0,30 |
| 612.100 | CHINA VANKE CO LTD - H | HKD | 1.440.798,90 | 0,76 |
| 643.000 | CHONGQING RURAL COMMERCIAL BANK CO LTD - H | HKD | 201.804,41 | 0,11 |
| 1.146.180 | COSCO SHIPPING HOLDINGS CO LTD - H | HKD | 1.512.371,73 | 0,80 |
| 178.800 | FUYAO GLASS INDUSTRY GROUP CO LTD | HKD | 822.969,81 | 0,43 |
| 7.103.469 | INDUSTRIAL & COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD - H | HKD | 3.399.067,67 | 1,80 |
| 339.100 | JIANGXI COPPER CO LTD - H | HKD | 526.883,36 | 0,28 |
| 58.500 | NEW CHINA LIFE INSURANCE CO LTD - H | HKD | 148.691,14 | 0,08 |
| 2.357.000 | PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP - H | HKD | 630.342,22 | 0,33 |
| 27.800 | PING AN INSURANCE GROUP CO OF CHINA LTD - H | HKD | 163.593,41 | 0,09 |
| 251.000 | SHANDONG GOLD MINING CO LTD - H | HKD | 382.229,61 | 0,20 |
| 618.000 | WEICHAI POWER CO LTD - H | HKD | 1.105.015,51 | 0,58 |
| | | | **17.418.307,03** | **9,20** |
| | **Russland** | | | |
| 47.800 | LUKOIL PJSC | RUB | 3.928.075,67 | 2,08 |
| 12.800 | MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR | USD | 106.468,79 | 0,06 |
| 1.024.410 | SBERBANK OF RUSSIA PJSC | RUB | 4.138.727,09 | 2,18 |
| 119.412 | TATNEFT PJSC | RUB | 747.862,88 | 0,39 |
| | | | **8.921.134,43** | **4,71** |
| | **Brasilien** | | | |
| 102.132 | BANCO SANTANDER BRASIL SA | BRL | 572.035,99 | 0,30 |
| 176.471 | BB SEGURIDADE PARTICIPACOES SA | BRL | 557.497,21 | 0,29 |
| 980.194 | B3 SA - BRASIL BOLSA BALCAO | BRL | 1.977.460,98 | 1,04 |
| 31.300 | CCR SA | BRL | 57.990,47 | 0,03 |
| 150.200 | EQUATORIAL ENERGIA SA | BRL | 602.940,35 | 0,32 |
| 92.400 | HYPERA SA | BRL | 470.266,78 | 0,25 |
| 1.059.900 | ITAUSA SA | BRL | 1.869.719,84 | 0,98 |
| 155.500 | MAGAZINE LUIZA SA | BRL | 353.106,73 | 0,19 |
| 222.200 | NATURA &CO HOLDING SA | BRL | 1.603.428,27 | 0,85 |
| 15.800 | PORTO SEGURO SA | BRL | 123.747,85 | 0,07 |
| 22.494 | SUL AMERICA SA | BRL | 90.759,60 | 0,05 |
| 12.000 | TOTVS SA | BRL | 68.598,54 | 0,04 |
| 21.900 | WEG SA | BRL | 137.434,14 | 0,07 |
| | | | **8.484.986,75** | **4,48** |
| | **Südafrika** | | | |
| 54.900 | BID CORP LTD | ZAR | 1.015.765,04 | 0,54 |
| 17.338 | BIDVEST GROUP LTD/THE | ZAR | 194.893,86 | 0,10 |
| 7.700 | CAPITEC BANK HOLDINGS LTD | ZAR | 803.323,35 | 0,42 |
| 44.811 | CLICKS GROUP LTD | ZAR | 713.680,13 | 0,38 |
| 41.100 | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | ZAR | 404.649,79 | 0,21 |
| 137.000 | RAND MERCHANT INVESTMENT HOLDINGS LTD | ZAR | 295.427,90 | 0,17 |
| 37.700 | TIGER BRANDS LTD | ZAR | 404.904,55 | 0,21 |
| 99.000 | VODACOM GROUP LTD | ZAR | 817.826,92 | 0,43 |
| 108.300 | WOOLWORTHS HOLDINGS LTD/SOUTH AFRICA | ZAR | 366.830,12 | 0,19 |
| | | | **5.017.301,66** | **2,65** |
| | **Malaysia** | | | |
| 253.900 | DIGI.COM BHD | MYR | 232.173,17 | 0,12 |
| 404.500 | HARTALEGA HOLDINGS BHD | MYR | 511.190,73 | 0,27 |
| 51.000 | HONG LEONG BANK BHD | MYR | 198.071,21 | 0,10 |
| 322.600 | KOSSAN RUBBER INDUSTRIES | MYR | 153.131,90 | 0,08 |
| 16.800 | NESTLE MALAYSIA BHD | MYR | 459.490,67 | 0,24 |
| 22.800 | PETRONAS DAGANGAN BHD | MYR | 89.580,21 | 0,05 |
| 507.500 | PRESS METAL ALUMINIUM HOLDINGS | MYR | 598.600,81 | 0,32 |
| 1.482.600 | PUBLIC BANK BHD | MYR | 1.239.960,38 | 0,65 |
| 249.200 | SIME DARBY BHD | MYR | 116.242,04 | 0,06 |
| 406.784 | SUPERMAX CORP BHD | MYR | 199.779,60 | 0,11 |
| 1.296.500 | TOP GLOVE CORP BHD | MYR | 767.280,81 | 0,41 |
| | | | **4.565.501,53** | **2,41** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 70.400 | YUM CHINA HOLDINGS INC | USD | 3.529.871,00 | 1,86 |
| | | | **3.529.871,00** | **1,86** |
| | **Indonesien** | | | |
| 1.309.000 | ACE HARDWARE INDONESIA TBK PT | IDR | 99.923,66 | 0,05 |
| 760.200 | ASTRA INTERNATIONAL TBK PT | IDR | 251.313,33 | 0,13 |
| 619.800 | INDOFOOD CBP SUKSES MAKMUR TBK PT | IDR | 311.073,50 | 0,16 |
| 5.318.000 | KALBE FARMA TBK PT | IDR | 457.098,02 | 0,25 |
| 8.745.200 | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT | IDR | 1.939.639,77 | 1,03 |
| 1.923.600 | UNILEVER INDONESIA TBK PT | IDR | 456.706,12 | 0,24 |
| | | | **3.515.754,40** | **1,86** |
| | **Vereinigte Arabische Emirate** | | | |
| 607.600 | ABU DHABI NATIONAL OIL CO FOR DISTRIBUTION PJSC | AED | 593.755,61 | 0,31 |
| 899.400 | ALDAR PROPERTIES PJSC | AED | 862.004,79 | 0,46 |
| 456.322 | DUBAI ISLAMIC BANK PJSC | AED | 530.607,32 | 0,28 |
| 884.500 | EMAAR PROPERTIES PJSC | AED | 847.724,30 | 0,45 |
| 38.500 | EMIRATES TELECOMMUNICATIONS GROUP CO PJSC | AED | 217.235,28 | 0,11 |
| | | | **3.051.327,30** | **1,61** |
| | **Hongkong** | | | |
| 45.000 | BYD ELECTRONIC INTERNATIONAL CO LTD | HKD | 136.507,42 | 0,07 |
| 224.000 | CHINA MERCHANTS HOLDINGS INTERNATIONAL CO LTD | HKD | 330.716,49 | 0,17 |
| 447.500 | CHINA RESOURCES PHARMACEUTICAL GROUP LTD | HKD | 189.405,76 | 0,10 |
| 235.000 | CITIC LTD | HKD | 215.549,66 | 0,11 |
| 1.846.000 | LENOVO GROUP LTD | HKD | 1.707.491,55 | 0,91 |
| 118.500 | SINOTRUK HONG KONG LTD | HKD | 151.906,98 | 0,08 |
| | | | **2.731.577,86** | **1,44** |
| | **Katar** | | | |
| 174.700 | BARWA REAL ESTATE CO | QAR | 130.329,35 | 0,07 |
| 341.400 | MASRAF AL RAYAN QSC | QAR | 362.375,80 | 0,20 |
| 122.805 | QATAR FUEL QSC | QAR | 522.099,28 | 0,28 |
| 61.800 | QATAR ISLAMIC BANK SAQ | QAR | 267.279,68 | 0,14 |
| 209.500 | QATAR NATIONAL BANK QPSC | QAR | 950.752,36 | 0,50 |
| | | | **2.232.836,47** | **1,19** |
| | **Bermuda** | | | |
| 1.012.600 | ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY LTD | HKD | 1.253.306,65 | 0,66 |
| 846.000 | BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE HOLDINGS LTD | HKD | 682.487,36 | 0,36 |
| 672.000 | HENGTEN NETWORKS GROUP LTD | HKD | 171.546,80 | 0,09 |
| | | | **2.107.340,81** | **1,11** |
| | **Mexiko** | | | |
| 2.068.300 | AMERICA MOVIL SAB DE CV | MXN | 1.587.054,34 | 0,83 |
| 113.200 | WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | MXN | 332.562,95 | 0,18 |
| | | | **1.919.617,29** | **1,01** |
| | **Thailand** | | | |
| 79.700 | CARABAO GROUP PCL | THB | 243.172,16 | 0,13 |
| 2.045.000 | LAND & HOUSES PCL | THB | 413.365,99 | 0,23 |
| 197.200 | MUANGTHAI CAPITAL PCL | THB | 292.063,40 | 0,15 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Emerging Markets High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 411.200 | PTT OIL & RETAIL BUSINESS PCL | THB | 287.514,73 | 0,15 |
| 330.100 | PTT PCL | THB | 327.328,95 | 0,17 |
| 243.100 | SRI TRANG GLOVES THAILAND PCL | THB | 193.156,48 | 0,10 |
| | | | **1.756.601,71** | **0,93** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 7.100 | GLOBANT SA | USD | 1.721.533,28 | 0,92 |
| | | | **1.721.533,28** | **0,92** |
| | **Chile** | | | |
| 14.264.100 | BANCO SANTANDER CHILE | CLP | 615.691,96 | 0,33 |
| 109.500 | EMPRESAS CMPC SA | CLP | 177.750,06 | 0,09 |
| 48.700 | EMPRESAS COPEC SA | CLP | 348.190,02 | 0,18 |
| 8.500 | SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE SA - B | CLP | 395.155,95 | 0,21 |
| | | | **1.536.787,99** | **0,81** |
| | **Ungarn** | | | |
| 20.080 | OTP BANK NYRT | HUF | 1.017.373,99 | 0,54 |
| 20.500 | RICHTER GEDEON NYRT | HUF | 484.229,50 | 0,25 |
| | | | **1.501.603,49** | **0,79** |
| | **Türkei** | | | |
| 160.300 | ASELSAN ELEKTRONIK SANAYI VE TICARET AS | TRY | 235.707,77 | 0,12 |
| 69.400 | BIM BIRLESIK MAGAZALAR AS | TRY | 430.699,95 | 0,23 |
| 19.500 | FORD OTOMOTIV SANAYI AS | TRY | 316.464,91 | 0,17 |
| 34.700 | TURKIYE PETROL RAFINERILERI AS | TRY | 386.214,51 | 0,20 |
| | | | **1.369.087,14** | **0,72** |
| | **Ägypten** | | | |
| 422.154 | COMMERCIAL INTERNATIONAL BANK EGYPT SAE | EGP | 988.494,85 | 0,52 |
| | | | **988.494,85** | **0,52** |
| | **Griechenland** | | | |
| 28.000 | OPAP SA | EUR | 374.640,00 | 0,20 |
| | | | **374.640,00** | **0,20** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 100.000 | MONETA MONEY BANK AS | CZK | 348.222,49 | 0,19 |
| | | | **348.222,49** | **0,19** |
| | **Philippinen** | | | |
| 85.510 | JOLLIBEE FOODS CORP | PHP | 295.635,04 | 0,16 |
| | | | **295.635,04** | **0,16** |
| | | | **187.917.973,41** | **99,27** |
| | **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | |
| | **Indien** | | | |
| 861.300 | BRITANNIA INDUSTRIES LTD 5.500% 03/06/2024 | INR | 2.912,49 | 0,00 |
| | | | **2.912,49** | **0,00** |
| | | | **2.912,49** | **0,00** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **187.920.885,90** | **99,27** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 332.587.832,27 | CZK | 13.086.132,21 | EUR | 19/10/2021 | 13.086.132,21 | 26.413,64 |
| 246.448,94 | EUR | 1.120.485,76 | PLN | 19/10/2021 | 246.448,94 | 3.073,69 |
| 10.963,88 | EUR | 278.623,00 | CZK | 19/10/2021 | 10.963,88 | (21,06) |
| 81.913.684,14 | PLN | 18.160.098,99 | EUR | 19/10/2021 | 18.160.098,99 | (368.027,25) |
| | | | | | **31.503.644,02** | **(338.560,98)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(338.560,98)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **187.920.885,90** | **99,27** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(338.560,98)** | **(0,18)** |
| **Bankguthaben** | **1.058.025,48** | **0,56** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **659.877,60** | **0,35** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **189.300.228,00** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Energy

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 138.971.377,51 |
| | 30.09.2020 | USD | 97.344.259,64 |
| | 30.09.2019 | USD | 89.201.433,96 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.082,07 |
| | 30.09.2020 | USD | 667,54 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.188,33 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 172,30 |
| | 30.09.2020 | EUR | 106,10 |
| | 30.09.2019 | EUR | 205,18 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 922,34 |
| | 30.09.2020 | USD | 574,66 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.033,15 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 204,11 |
| | 30.09.2020 | EUR | 124,74 |
| | 30.09.2019 | EUR | 239,44 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 189,61 |
| | 30.09.2020 | USD | 117,25 |
| | 30.09.2019 | USD | 209,22 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 595,85 |
| | 30.09.2020 | EUR | 368,73 |
| | 30.09.2019 | EUR | 716,61 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 46.840,80 |
| | 30.09.2020 | HUF | 29.308,45 |
| | 30.09.2019 | HUF | 52.539,99 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 832,89 |
| | 30.09.2020 | USD | 521,49 |
| | 30.09.2019 | USD | 942,27 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 4.257,44 |
| | 30.09.2020 | CZK | 2.698,68 |
| | 30.09.2019 | CZK | 5.094,71 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 154,76 |
| | 30.09.2020 | USD | 97,87 |
| | 30.09.2019 | USD | 178,63 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 3.409,84 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.181,62 |
| | 30.09.2019 | USD | 3.990,10 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 174,81 |
| | 30.09.2020 | USD | 111,96 |
| | 30.09.2019 | USD | 204,84 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 10.515 |
| | 30.09.2020 | 9.986 |
| | 30.09.2019 | 8.542 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 19.694 |
| | 30.09.2020 | 22.945 |
| | 30.09.2019 | 7.345 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 13.946 |
| | 30.09.2020 | 17.479 |
| | 30.09.2019 | 17.225 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 558 |
| | 30.09.2020 | 856 |
| | 30.09.2019 | 296 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 2.522 |
| | 30.09.2020 | 2.787 |
| | 30.09.2019 | 3.312 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 13.025 |
| | 30.09.2020 | 14.921 |
| | 30.09.2019 | 5.268 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 8.727 |
| | 30.09.2020 | 6.011 |
| | 30.09.2019 | 2.948 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 66.419 |
| | 30.09.2020 | 86.603 |
| | 30.09.2019 | 32.799 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 52.328 |
| | 30.09.2020 | 62.185 |
| | 30.09.2019 | 16.275 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 178.270 |
| | 30.09.2020 | 123.918 |
| | 30.09.2019 | 64.512 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1.902 |
| | 30.09.2020 | 2.533 |
| | 30.09.2019 | 1.944 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1.681 |
| | 30.09.2020 | 2.015 |
| | 30.09.2019 | 2.601 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 73,95 |
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 5,00 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Energy

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| **Laufende Kosten in %*** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 3,30% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (23,03%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Energy

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **138.312.281,19** |
| Aktien | | 138.312.281,19 |
| **Bankguthaben** | | **2.215.427,73** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **8.671.986,48** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***149.199.695,40*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(10.023.393,58)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(204.924,31)** |
| Devisentermingeschäfte | | (204.924,31) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(10.228.317,89)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***138.971.377,51*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **5.036.735,95** |
| Dividenden | | 4.883.104,13 |
| Sonstige Erträge | 10 | 153.631,82 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(2.801.611,75)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.240.843,49) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (498.301,42) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (2.086,49) |
| Abonnementsteuer | 9 | (59.843,74) |
| Bankzinsen | | (536,61) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **2.235.124,20** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 17.608.779,25 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (7.975.106,96) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 129.369,63 |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 821.826,19 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (765.122,71) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 45.601.836,22 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 227.032,44 |
| **Ergebnis** | | **57.883.738,26** |
| Zeichnungen | | 148.827.636,29 |
| Rücknahmen | | (164.893.132,05) |
| Ausschüttung | | (191.124,63) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 97.344.259,64 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***138.971.377,51*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Energy

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 100.400 | BAKER HUGHES CO - A | USD | 2.482.892,00 | 1,79 |
| 84.700 | CHENIERE ENERGY INC | USD | 8.272.649,00 | 5,95 |
| 127.667 | CHEVRON CORP | USD | 12.951.817,15 | 9,32 |
| 100.256 | CONOCOPHILLIPS | USD | 6.794.349,12 | 4,89 |
| 30.300 | DEVON ENERGY CORP | USD | 1.075.953,00 | 0,77 |
| 84.413 | EOG RESOURCES INC | USD | 6.775.831,51 | 4,88 |
| 168.807 | EXXON MOBIL CORP | USD | 9.929.227,74 | 7,14 |
| 91.500 | HALLIBURTON CO | USD | 1.978.230,00 | 1,42 |
| 27.000 | HESS CORP | USD | 2.108.970,00 | 1,52 |
| 11.400 | HOLLYFRONTIER CORP | USD | 377.682,00 | 0,27 |
| 56.700 | MARATHON PETROLEUM CORP | USD | 3.504.627,00 | 2,52 |
| 128.200 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP | USD | 3.792.156,00 | 2,73 |
| 61.600 | ONEOK INC | USD | 3.572.184,00 | 2,57 |
| 62.119 | PHILLIPS 66 | USD | 4.350.193,57 | 3,13 |
| 22.435 | PIONEER NATURAL RESOURCES CO | USD | 3.735.651,85 | 2,69 |
| 21.900 | TARGA RESOURCES CORP | USD | 1.077.699,00 | 0,78 |
| 26.971 | VALERO ENERGY CORP | USD | 1.903.343,47 | 1,37 |
| 134.680 | WILLIAMS COS INC | USD | 3.493.599,20 | 2,51 |
| | | | **78.177.055,61** | **56,25** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 1.520.878 | BP PLC | GBP | 6.978.449,68 | 5,03 |
| 55.453 | ROYAL DUTCH SHELL PLC - A | GBP | 1.237.444,33 | 0,89 |
| 267.537 | ROYAL DUTCH SHELL PLC - A | EUR | 6.025.124,80 | 4,34 |
| 116.821 | ROYAL DUTCH SHELL PLC - B SHS | EUR | 2.591.358,78 | 1,86 |
| | | | **16.832.377,59** | **12,12** |
| **Frankreich** | | | | |
| 6.200 | GAZTRANSPORT ET TECHNIGAZ SA | EUR | 465.260,47 | 0,33 |
| 139.179 | TOTALENERGIES SE | EUR | 6.667.397,48 | 4,80 |
| | | | **7.132.657,95** | **5,13** |
| **Italien** | | | | |
| 510.900 | ENI SPA | EUR | 6.836.473,72 | 4,92 |
| | | | **6.836.473,72** | **4,92** |
| **Spanien** | | | | |
| 442.082 | REPSOL SA | EUR | 5.788.540,76 | 4,17 |
| | | | **5.788.540,76** | **4,17** |
| **Kanada** | | | | |
| 48.600 | GIBSON ENERGY INC | CAD | 892.320,32 | 0,64 |
| 163.200 | PARKLAND CORP/CANADA | CAD | 4.584.826,93 | 3,30 |
| 8.400 | PEMBINA PIPELINE CORP | CAD | 266.219,36 | 0,19 |
| | | | **5.743.366,61** | **4,13** |
| **Curacao** | | | | |
| 143.806 | SCHLUMBERGER NV | USD | 4.262.409,84 | 3,08 |
| | | | **4.262.409,84** | **3,08** |
| **Japan** | | | | |
| 21.500 | IDEMITSU KOSAN CO LTD | JPY | 565.990,95 | 0,41 |
| 155.600 | INPEX CORP | JPY | 1.218.013,16 | 0,87 |
| 17.700 | IWATANI CORP | JPY | 1.039.146,83 | 0,75 |
| | | | **2.823.150,94** | **2,03** |
| **Finnland** | | | | |
| 45.400 | NESTE OYJ | EUR | 2.576.621,64 | 1,85 |
| | | | **2.576.621,64** | **1,85** |
| **Australien** | | | | |
| 48.500 | AMPOL LTD | AUD | 976.284,49 | 0,70 |
| 45.600 | WOODSIDE PETROLEUM LTD | AUD | 784.245,43 | 0,56 |
| 92.300 | WORLEY LTD | AUD | 658.761,48 | 0,48 |
| | | | **2.419.291,40** | **1,74** |
| **Portugal** | | | | |
| 148.107 | GALP ENERGIA SGPS SA - B | EUR | 1.682.156,33 | 1,21 |
| | | | **1.682.156,33** | **1,21** |
| **Schweden** | | | | |
| 32.800 | LUNDIN ENERGY AB | SEK | 1.225.236,18 | 0,88 |
| | | | **1.225.236,18** | **0,88** |
| **Papua-Neuguinea** | | | | |
| 300.700 | OIL SEARCH LTD | AUD | 950.715,96 | 0,68 |
| | | | **950.715,96** | **0,68** |
| **Norwegen** | | | | |
| 27.400 | EQUINOR ASA | NOK | 698.869,89 | 0,50 |
| | | | **698.869,89** | **0,50** |
| **Deutschland** | | | | |
| 9.700 | VERBIO VEREINIGTE BIOENERGIE AG | EUR | 639.659,26 | 0,46 |
| | | | **639.659,26** | **0,46** |
| **Luxemburg** | | | | |
| 49.700 | TENARIS SA | EUR | 523.697,51 | 0,38 |
| | | | **523.697,51** | **0,38** |
| | | | **138.312.281,19** | **99,53** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **138.312.281,19** | **99,53** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 84.958,62 | USD | 1.833.827,88 | CZK | 19/10/2021 | 84.958,62 | 1.141,60 |
| 217.342.421,93 | CZK | 10.139.928,89 | USD | 19/10/2021 | 10.139.928,89 | (206.065,91) |
| | | | | | **10.224.887,51** | **(204.924,31)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(204.924,31)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Energy

*(ausgedrückt in USD)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **138.312.281,19** | **99,53** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(204.924,31)** | **(0,15)** |
| **Bankguthaben** | **2.215.427,73** | **1,59** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(1.351.407,10)** | **(0,97)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **138.971.377,51** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Covered Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 19.230.415,10 |
| | 30.09.2020 | EUR | 25.469.910,57 |
| | 30.09.2019 | EUR | 36.522.556,86 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.313,62 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.409,46 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.402,32 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.480,10 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.557,23 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.530,96 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 259.597,74 |
| | 30.09.2020 | EUR | 262.591,57 |
| | 30.09.2019 | EUR | 261.375,56 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 277,96 |
| | 30.09.2020 | EUR | 282,40 |
| | 30.09.2019 | EUR | 282,33 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 74 |
| | 30.09.2020 | | 101 |
| | 30.09.2019 | | 1.626 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0.31 |
| | 30.09.2020 | | 6 |
| | 30.09.2019 | | 6 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | | 70 |
| | 30.09.2020 | | 92 |
| | 30.09.2019 | | 97 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | | 1.698 |
| | 30.09.2020 | | 1.796 |
| | 30.09.2019 | | 2.135 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,37% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,07% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | | 0,01% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | | 0,45% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 42,20% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Covered Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **18.860.266,87** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 14.401,81 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 18.845.865,06 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **15.089,97** |
| Futures | | 15.089,97 |
| **Bankguthaben** | | **157.299,72** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **4.375,50** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **391.309,14** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***19.428.341,20*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(197.926,10)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(197.926,10)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***19.230.415,10*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **176.787,98** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 174.307,73 |
| Zinsen auf Swaps | | 2.480,25 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(8.378,44)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.740,22) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.506,75) |
| Abonnementsteuer | 9 | (2.437,18) |
| Bankzinsen | | (1.694,29) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **168.409,54** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 236.782,74 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (12.770,10) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 94.237,28 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (37.775,86) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (690.439,24) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (30.354,85) |
| **Ergebnis** | | **(271.910,49)** |
| Zeichnungen | | 176.636,21 |
| Rücknahmen | | (6.144.221,19) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 25.469.910,57 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***19.230.415,10*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Covered Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Frankreich** | | | |
| 100.000 | AXA BANK EUROPE SCF 0.010% 22/01/2027 EMTN | EUR | 100.824,51 | 0,52 |
| 200.000 | AXA BANK EUROPE SCF 0.750% 06/03/2029 EMTN | EUR | 211.032,63 | 1,10 |
| 400.000 | AXA HOME LOAN SFH SA 0.050% 05/07/2027 | EUR | 403.918,52 | 2,10 |
| 200.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN | EUR | 206.293,40 | 1,07 |
| 100.000 | BPCE SA 0.250% 14/01/2031 | EUR | 96.987,07 | 0,50 |
| 100.000 | BPCE SFH SA 0.010% 27/05/2030 EMTN | EUR | 99.392,02 | 0,52 |
| 100.000 | BPCE SFH SA 0.125% 03/12/2030 | EUR | 100.030,63 | 0,52 |
| 100.000 | BPCE SFH SA 0.625% 22/09/2027 | EUR | 104.463,18 | 0,54 |
| 200.000 | BPCE SFH SA 0.625% 29/05/2031 | EUR | 208.830,84 | 1,09 |
| 200.000 | CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 0.010% 08/10/2029 | EUR | 199.571,67 | 1,04 |
| 300.000 | CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 0.125% 30/04/2027 EMTN | EUR | 304.713,54 | 1,58 |
| 200.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.250% 11/05/2032 EMTN | EUR | 221.661,04 | 1,15 |
| 100.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.500% 28/06/2038 | EUR | 116.764,88 | 0,61 |
| 250.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 5.375% 08/07/2024 EMTN | EUR | 289.942,80 | 1,51 |
| 200.000 | CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 2.000% 07/05/2024 EMTN | EUR | 212.503,64 | 1,11 |
| 100.000 | CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 3.875% 25/04/2055 EMTN | EUR | 185.606,94 | 0,97 |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.375% 24/03/2023 EMTN | EUR | 202.540,26 | 1,05 |
| 600.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.750% 05/05/2027 EMTN | EUR | 630.395,45 | 3,28 |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.375% 03/02/2032 EMTN | EUR | 224.033,05 | 1,16 |
| 100.000 | CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 1.000% 30/01/2029 EMTN | EUR | 107.427,81 | 0,56 |
| 300.000 | CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 2.500% 11/09/2023 EMTN | EUR | 317.279,25 | 1,65 |
| 200.000 | LA BANQUE POSTALE HOME LOAN SFH SA 0.625% 23/06/2027 EMTN | EUR | 208.861,61 | 1,09 |
| 200.000 | SOCIETE GENERALE SFH SA 0.500% 30/01/2025 | EUR | 205.598,66 | 1,07 |
| | | | **4.958.673,40** | **25,79** |
| | **Spanien** | | | |
| 100.000 | AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA 3.750% 14/12/2022 | EUR | 104.943,04 | 0,55 |
| 400.000 | AYT CEDULAS CAJAS GLOBAL FTA 4.250% 25/10/2023 | EUR | 437.804,56 | 2,27 |
| 100.000 | CAIXABANK SA 10/07/2026 FRN EMTN | EUR | 102.307,38 | 0,53 |
| 100.000 | CAIXABANK SA 4.125% 24/03/2036 | EUR | 151.678,57 | 0,79 |
| 100.000 | DEUTSCHE BANK SA ESPANOLA 1.125% 20/01/2023 EMTN | EUR | 101.920,73 | 0,53 |
| 200.000 | PITCH1 5.125% 20/07/2022 | EUR | 208.762,48 | 1,09 |
| 200.000 | PROGRAMA CEDULAS TDA FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS 4.250% 10/04/2031 | EUR | 275.871,49 | 1,43 |
| 200.000 | PROGRAMA CEDULAS TDA FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS 4.250% 28/03/2027 | EUR | 247.185,01 | 1,29 |
| | | | **1.630.473,26** | **8,48** |
| | **Kanada** | | | |
| 200.000 | BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.010% 18/03/2025 | EUR | 202.104,74 | 1,05 |
| 200.000 | BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.375% 10/03/2023 EMTN | EUR | 202.418,62 | 1,05 |
| 200.000 | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE 0.040% 09/07/2027 EMTN | EUR | 201.516,75 | 1,05 |
| 100.000 | HSBC BANK CANADA 0.010% 14/09/2026 | EUR | 100.763,75 | 0,52 |
| 150.000 | NATIONAL BANK OF CANADA 0.010% 25/03/2028 | EUR | 150.372,46 | 0,78 |
| 200.000 | ROYAL BANK OF CANADA 0.010% 21/01/2027 EMTN | EUR | 201.371,29 | 1,05 |
| 300.000 | ROYAL BANK OF CANADA 0.050% 19/06/2026 EMTN | EUR | 303.151,16 | 1,58 |
| 200.000 | TORONTO-DOMINION BANK/THE ZCP 09/02/2024 | EUR | 201.805,50 | 1,05 |
| | | | **1.563.504,27** | **8,13** |
| | **Norwegen** | | | |
| 100.000 | DNB BOLIGKREDITT AS 0.010% 08/10/2027 | EUR | 100.676,58 | 0,52 |
| 233.000 | DNB BOLIGKREDITT AS 0.010% 21/01/2031 | EUR | 230.197,06 | 1,20 |
| 380.000 | DNB BOLIGKREDITT AS 0.250% 18/04/2023 EMTN | EUR | 384.214,75 | 2,00 |
| 150.000 | SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT AS 0.010% 22/09/2027 | EUR | 151.020,92 | 0,79 |
| 200.000 | SPAREBANK 1 BOLIGKREDITT AS 0.125% 05/11/2029 EMTN | EUR | 200.833,50 | 1,04 |
| 100.000 | SR-BOLIGKREDITT AS 0.010% 10/03/2031 EMTN | EUR | 98.470,61 | 0,51 |
| 300.000 | SR-BOLIGKREDITT AS 0.750% 17/10/2025 EMTN | EUR | 312.209,62 | 1,62 |
| | | | **1.477.623,04** | **7,68** |
| | **Niederlande** | | | |
| 100.000 | ABN AMRO BANK NV 0.400% 17/09/2041 EMTN | EUR | 97.130,98 | 0,51 |
| 200.000 | ABN AMRO BANK NV 1.375% 12/01/2037 | EUR | 227.658,08 | 1,18 |
| 100.000 | ACHMEA BANK NV 0.010% 16/06/2025 | EUR | 100.963,44 | 0,53 |
| 100.000 | AEGON BANK NV 0.010% 16/11/2025 EMTN | EUR | 100.894,01 | 0,52 |
| 100.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.010% 27/11/2040 EMTN | EUR | 90.467,58 | 0,47 |
| 200.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.875% 01/02/2029 | EUR | 213.110,59 | 1,12 |
| 200.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 1.250% 31/05/2032 EMTN | EUR | 221.631,16 | 1,15 |
| 200.000 | DE VOLKSBANK NV 0.500% 30/01/2026 EMTN | EUR | 206.490,97 | 1,07 |
| 200.000 | NIBC BANK NV 0.250% 09/09/2026 EMTN | EUR | 198.982,72 | 1,03 |
| | | | **1.457.329,53** | **7,58** |
| | **Österreich** | | | |
| 300.000 | BAWAG PSK BANK FUER ARBEIT UND WIRTSCHAFT UND OESTERREICHISCHE POSTSPARKASSE AG 0.010% 21/01/2028 EMTN | EUR | 301.880,48 | 1,58 |
| 100.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.100% 15/01/2030 EMTN | EUR | 100.312,82 | 0,52 |
| 300.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.250% 26/06/2024 EMTN | EUR | 305.216,42 | 1,59 |
| 200.000 | ERSTE GROUP BANK AG 16/11/2028 FRN EMTN | EUR | 197.197,64 | 1,03 |
| 100.000 | UNICREDIT BANK AUSTRIA AG 0.625% 20/03/2029 EMTN | EUR | 104.674,30 | 0,54 |
| 200.000 | UNICREDIT BANK AUSTRIA AG 2.375% 22/01/2024 EMTN | EUR | 212.889,82 | 1,11 |
| | | | **1.222.171,48** | **6,37** |
| | **Deutschland** | | | |
| 300.000 | COMMERZBANK AG 0.500% 09/06/2026 EMTN | EUR | 310.451,19 | 1,61 |
| 218.000 | DZ HYP AG 0.010% 12/11/2027 EMTN | EUR | 219.901,69 | 1,14 |
| 100.000 | SANTANDER CONSUMER BANK AG 0.050% 14/02/2030 | EUR | 99.937,63 | 0,52 |
| 540.000 | UNICREDIT BANK AG 0.625% 20/11/2025 EMTN | EUR | 560.355,45 | 2,92 |
| | | | **1.190.645,96** | **6,19** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 400.000 | LLOYDS BANK PLC 4.875% 13/01/2023 EMTN | EUR | 427.261,25 | 2,22 |
| 200.000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 0.750% 26/10/2022 EMTN | EUR | 202.656,12 | 1,05 |
| 315.000 | SANTANDER UK PLC 0.100% 12/05/2024 EMTN | EUR | 318.610,35 | 1,66 |
| | | | **948.527,72** | **4,93** |
| | **Australien** | | | |
| 333.000 | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.875% 19/02/2029 EMTN | EUR | 352.749,99 | 1,83 |
| 150.000 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD 0.010% 06/01/2029 | EUR | 149.451,67 | 0,78 |
| 100.000 | WESTPAC BANKING CORP 0.010% 22/09/2028 EMTN | EUR | 99.753,61 | 0,52 |
| 200.000 | WESTPAC BANKING CORP 0.500% 17/05/2024 GMTN | EUR | 204.437,47 | 1,06 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Covered Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 100.000 | WESTPAC BANKING CORP 1.375% 17/05/2032 GMTN | EUR | 111.391,79 | 0,58 |
| | | | **917.784,53** | **4,77** |
| | **Südkorea** | | | |
| 200.000 | HANA BANK 0.010% 26/01/2026 | EUR | 201.008,60 | 1,05 |
| 118.000 | KOOKMIN BANK 0.052% 15/07/2025 | EUR | 118.946,54 | 0,62 |
| 200.000 | KOREA HOUSING FINANCE CORP 0.010% 07/07/2025 | EUR | 201.158,98 | 1,05 |
| 200.000 | KOREA HOUSING FINANCE CORP 0.100% 18/06/2024 | EUR | 201.872,97 | 1,04 |
| | | | **722.987,09** | **3,76** |
| | **Italien** | | | |
| 100.000 | BANCO BPM SPA 0.625% 08/06/2023 EMTN | EUR | 101.650,19 | 0,53 |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 0.250% 30/09/2024 EMTN | EUR | 203.349,26 | 1,06 |
| 100.000 | INTESA SANPAOLO SPA 2.125% 26/05/2025 EMTN | EUR | 107.222,17 | 0,56 |
| 100.000 | MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.125% 12/08/2024 EMTN | EUR | 104.300,42 | 0,54 |
| 100.000 | UNICREDIT SPA 0.325% 19/01/2026 EMTN | EUR | 100.013,26 | 0,52 |
| | | | **616.535,30** | **3,21** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 100.000 | ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 0.200% 23/09/2027 EMTN | EUR | 99.516,42 | 0,52 |
| 100.000 | ASB FINANCE LTD/LONDON 0.250% 21/05/2031 EMTN | EUR | 99.796,63 | 0,52 |
| 200.000 | BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.500% 03/07/2024 | EUR | 204.498,46 | 1,06 |
| 100.000 | WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.010% 08/06/2028 EMTN | EUR | 99.680,18 | 0,52 |
| | | | **503.491,69** | **2,62** |
| | **Belgien** | | | |
| 200.000 | ARGENTA SPAARBANK NV 0.010% 11/02/2031 EMTN | EUR | 197.869,47 | 1,02 |
| 200.000 | ING BELGIUM SA 0.010% 20/02/2030 | EUR | 199.111,56 | 1,04 |
| | | | **396.981,03** | **2,06** |
| | **Japan** | | | |
| 191.000 | SUMITOMO MITSUI BANKING CORP 0.010% 10/09/2025 EMTN | EUR | 191.890,91 | 1,00 |
| 200.000 | SUMITOMO MITSUI TRUST BANK LTD 0.010% 15/10/2027 EMTN | EUR | 198.748,55 | 1,03 |
| | | | **390.639,46** | **2,03** |
| | **Singapur** | | | |
| 150.000 | UNITED OVERSEAS BANK LTD 0.010% 01/12/2027 | EUR | 150.340,06 | 0,78 |
| 100.000 | UNITED OVERSEAS BANK LTD 0.100% 25/05/2029 GMTN | EUR | 100.034,52 | 0,52 |
| | | | **250.374,58** | **1,30** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 200.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN | EUR | 200.416,20 | 1,04 |
| | | | **200.416,20** | **1,04** |
| | **Schweiz** | | | |
| 200.000 | UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN | EUR | 198.307,50 | 1,03 |
| | | | **198.307,50** | **1,03** |
| | **Dänemark** | | | |
| 100.000 | JYSKE REALKREDIT AS 0.010% 01/10/2027 | EUR | 100.532,59 | 0,52 |
| | | | **100.532,59** | **0,52** |
| | **Schweden** | | | |
| 100.000 | STADSHYPOTEK AB 0.010% 30/09/2030 EMTN | EUR | 98.866,43 | 0,51 |
| | | | **98.866,43** | **0,51** |
| | | | **18.845.865,06** | **98,00** |
| | **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | |
| | **Offene Fonds** | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 15 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 14.401,81 | 0,08 |
| | | | **14.401,81** | **0,08** |
| | | | **14.401,81** | **0,08** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **18.860.266,87** | **98,08** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| (1) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 134.930,00 | 40,00 |
| (3) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 509.460,00 | 8.339,97 |
| (1) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 203.340,00 | 7.020,00 |
| 6 | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 673.230,00 | (310,00) |
| | | | **1.520.960,00** | **15.089,97** |
| | **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | **15.089,97** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **18.860.266,87** | **98,08** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **15.089,97** | **0,08** |
| **Bankguthaben** | **157.299,72** | **0,82** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **197.758,54** | **1,02** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **19.230.415,10** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 1.653.937.068,83 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.409.318.660,36 |
| | 30.09.2019 | EUR | 816.767.339,92 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.238,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.193,49 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.170,71 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 194,42 |
| | 30.09.2020 | EUR | 191,37 |
| | 30.09.2019 | EUR | 190,25 |
| Capitalisation Q (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.499,14 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.382,31 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.320,56 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 197,32 |
| | 30.09.2020 | EUR | 193,47 |
| | 30.09.2019 | EUR | 191,54 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 159,89 |
| | 30.09.2020 | EUR | 157,27 |
| | 30.09.2019 | EUR | 156,25 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 184,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | 182,53 |
| | 30.09.2019 | EUR | 181,92 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.858,32 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.672,16 |
| | 30.09.2019 | EUR | 7.565,18 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.480,32 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.380,56 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.335,87 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.682,37 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.656,00 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.646,32 |
| Distribution (HY) Z Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 156.623,13 |
| | 30.09.2020 | CZK | 152.831,09 |
| | 30.09.2019 | CZK | - |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 321.513 |
| | 30.09.2020 | | 285.815 |
| | 30.09.2019 | | 192.093 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 73.441 |
| | 30.09.2020 | | 107.387 |
| | 30.09.2019 | | 215.614 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation Q (EUR) | 30.09.2021 | 28.922 |
| | 30.09.2020 | 20.848 |
| | 30.09.2019 | 11.671 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 4.369 |
| | 30.09.2020 | 5.434 |
| | 30.09.2019 | 57.846 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 1.180 |
| | 30.09.2020 | 1.213 |
| | 30.09.2019 | 1.687 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 23.650 |
| | 30.09.2020 | 25.634 |
| | 30.09.2019 | 26.704 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 48.048 |
| | 30.09.2020 | 27.947 |
| | 30.09.2019 | 27.675 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 63.132 |
| | 30.09.2020 | 74.239 |
| | 30.09.2019 | 11.000 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 5.160 |
| | 30.09.2020 | 6.524 |
| | 30.09.2019 | 7.540 |
| Distribution (HY) Z Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 3.752 |
| | 30.09.2020 | 3.375 |
| | 30.09.2019 | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Dividende** | | | |
| Distribution I (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 11,05 |
| Distribution (HY) Z Hedged (i) (CZK) | 30.07.2021 | CZK | 340,10 |
| Distribution (HY) Z Hedged (i) (CZK) | 29.01.2021 | CZK | 317,63 |

| | | |
|---|---|---|
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation Q (EUR) | 30.09.2021 | 0,38% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 1,20% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,13% |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Distribution (HY) Z Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 0,15% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 79,77% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **1.659.447.812,16** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 31.088.579,12 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 1.628.359.233,04 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **46.545,52** |
| Devisentermingeschäfte | | 46.545,52 |
| **Bankguthaben** | | **8.237.932,84** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **1.015.157,63** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **34.242.966,60** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***1.702.990.414,75*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(5.478.660,31)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(42.430.398,96)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(1.144.286,65)** |
| Credit Default Swaps | | (978.806,98) |
| Zinsswaps | | (159.660,97) |
| Futures | | (5.818,70) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(49.053.345,92)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.653.937.068,83*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **17.394.152,99** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 16.980.209,16 |
| Zinsen auf Swaps | | 407.623,89 |
| Sonstige Erträge | 10 | 6.319,94 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(6.847.521,83)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (4.294.143,73) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.825.489,40) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (4.636,32) |
| Abonnementsteuer | 9 | (163.378,90) |
| Bankzinsen | | (14.766,39) |
| Zinsen auf Swaps | | (545.107,09) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **10.546.631,16** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 36.877.663,32 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (2.175.281,44) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 9.369.014,55 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (8.779.702,65) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 240.730,35 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (250.491,21) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (14.692.044,79) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 513.264,05 |
| **Ergebnis** | | **31.649.783,34** |
| Zeichnungen | | 496.292.664,47 |
| Rücknahmen | | (282.403.312,98) |
| Ausschüttung | | (920.726,36) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 1.409.318.660,36 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.653.937.068,83*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Niederlande** | | | | |
| 8.200.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP | EUR | 8.423.477,88 | 0,52 |
| 2.000.000 | ABN AMRO BANK NV 0.500% 23/09/2029 EMTN | EUR | 1.983.228,88 | 0,12 |
| 4.474.000 | AGCO INTERNATIONAL HOLDINGS BV 0.800% 06/10/2028 | EUR | 4.496.472,05 | 0,27 |
| 1.146.000 | AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY FINANCING BV 1.125% 11/01/2029 EMTN | EUR | 1.168.433,23 | 0,07 |
| 9.600.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 1.125% 17/09/2025 | EUR | 10.030.567,01 | 0,62 |
| 3.850.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 01/10/2046 FRN EMTN | EUR | 4.384.133,83 | 0,27 |
| 3.339.000 | ASML HOLDING NV 0.250% 25/02/2030 | EUR | 3.319.659,04 | 0,20 |
| 3.738.000 | ASML HOLDING NV 0.625% 07/05/2029 | EUR | 3.849.073,44 | 0,23 |
| 7.183.000 | ATRADIUS FINANCE BV 23/09/2044 FRN | EUR | 8.017.958,31 | 0,48 |
| 1.600.000 | BAYER CAPITAL CORP BV 1.500% 26/06/2026 | EUR | 1.691.817,60 | 0,10 |
| 7.700.000 | BRENNTAG FINANCE BV 0.500% 06/10/2029 EMTN | EUR | 7.653.469,13 | 0,47 |
| 380.000 | BRENNTAG FINANCE BV 1.125% 27/09/2025 | EUR | 395.358,34 | 0,02 |
| 400.000 | CITYCON TREASURY BV 1.625% 12/03/2028 EMTN | EUR | 408.363,52 | 0,02 |
| 1.340.000 | CONTI-GUMMI FINANCE BV 2.125% 27/11/2023 EMTN | EUR | 1.402.158,34 | 0,08 |
| 1.500.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 3.875% 25/07/2023 | EUR | 1.610.032,80 | 0,10 |
| 372.000 | CRH FUNDING BV 1.875% 09/01/2024 EMTN | EUR | 387.822,13 | 0,02 |
| 1.364.000 | CTP NV 0.500% 21/06/2025 EMTN | EUR | 1.371.413,82 | 0,08 |
| 1.000.000 | CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN | EUR | 1.012.881,81 | 0,06 |
| 4.137.000 | CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN | EUR | 4.151.509,66 | 0,25 |
| 1.000.000 | CTP NV 1.250% 21/06/2029 EMTN | EUR | 1.005.103,04 | 0,06 |
| 2.367.000 | CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN | EUR | 2.342.105,08 | 0,14 |
| 646.000 | CTP NV 2.125% 01/10/2025 EMTN | EUR | 689.112,70 | 0,04 |
| 3.852.000 | DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN | EUR | 3.821.656,14 | 0,23 |
| 300.000 | DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN | EUR | 302.108,33 | 0,02 |
| 3.600.000 | DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN | EUR | 3.777.402,06 | 0,23 |
| 4.900.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 0.875% 30/01/2024 EMTN | EUR | 5.028.046,80 | 0,30 |
| 4.800.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.125% 22/05/2026 EMTN | EUR | 5.046.331,25 | 0,31 |
| 923.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 03/04/2028 EMTN | EUR | 1.000.593,41 | 0,06 |
| 2.000.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 3.250% 17/01/2028 EMTN | EUR | 2.397.022,88 | 0,14 |
| 2.355.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032 | EUR | 2.308.207,75 | 0,14 |
| 200.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.250% 01/02/2031 | EUR | 203.226,92 | 0,01 |
| 375.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030 | EUR | 393.895,17 | 0,02 |
| 1.848.000 | DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031 | EUR | 1.767.550,26 | 0,11 |
| 6.065.000 | EDP FINANCE BV 1.125% 12/02/2024 EMTN | EUR | 6.256.808,05 | 0,38 |
| 4.428.000 | EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN | EUR | 4.760.979,00 | 0,29 |
| 2.000.000 | EDP FINANCE BV 2.625% 18/01/2022 EMTN | EUR | 2.018.055,66 | 0,12 |
| 5.018.000 | ELM BV FOR FIRMENICH INTERNATIONAL SA FRN PERP | EUR | 5.394.674,87 | 0,33 |
| 9.550.000 | ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP | EUR | 10.254.312,50 | 0,63 |
| 6.500.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.500% 17/06/2030 EMTN | EUR | 6.471.948,15 | 0,39 |
| 7.549.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 17/06/2036 EMTN | EUR | 7.346.217,25 | 0,44 |
| 3.600.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN | EUR | 3.777.682,43 | 0,23 |
| 11.600.000 | ENEXIS HOLDING NV 0.875% 28/04/2026 EMTN | EUR | 12.085.717,06 | 0,74 |
| 5.200.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN | EUR | 7.930.756,81 | 0,48 |
| 540.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.000% 22/04/2027 | EUR | 566.230,32 | 0,03 |
| 1.205.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.625% 22/04/2032 | EUR | 1.323.482,47 | 0,08 |
| 1.576.000 | HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.750% 06/09/2029 EMTN | EUR | 1.537.956,42 | 0,09 |
| 200.000 | HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.375% 03/03/2027 EMTN | EUR | 207.442,44 | 0,01 |
| 3.400.000 | HEINEKEN NV 1.000% 04/05/2026 EMTN | EUR | 3.553.682,45 | 0,21 |
| 1.900.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 1.917.632,48 | 0,12 |
| 5.500.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 5.678.750,00 | 0,34 |
| 1.300.000 | ING GROEP NV 11/04/2028 FRN EMTN | EUR | 1.358.946,20 | 0,08 |
| 1.000.000 | ING GROEP NV 15/02/2029 FRN EMTN | EUR | 1.054.191,30 | 0,06 |
| 3.700.000 | ING GROEP NV 18/02/2029 FRN | EUR | 3.625.232,99 | 0,22 |
| 400.000 | ING GROEP NV 22/03/2030 FRN | EUR | 420.902,74 | 0,03 |
| 6.100.000 | ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN | EUR | 6.471.059,58 | 0,39 |
| 2.120.000 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 1.750% 02/04/2027 | EUR | 2.300.163,54 | 0,14 |
| 2.210.000 | KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN | EUR | 2.234.371,31 | 0,14 |
| 2.000.000 | KONINKLIJKE DSM NV 2.375% 03/04/2024 EMTN | EUR | 2.121.624,54 | 0,13 |
| 3.000.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 0.500% 22/05/2026 | EUR | 3.069.248,04 | 0,19 |
| 1.200.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 1.375% 02/05/2028 | EUR | 1.288.777,22 | 0,08 |
| 1.200.000 | LINDE FINANCE BV 0.550% 19/05/2032 EMTN | EUR | 1.214.746,40 | 0,07 |
| 2.598.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 0.875% 17/09/2026 | EUR | 2.677.475,96 | 0,16 |
| 3.900.000 | MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDINGS NETHERLANDS BV 1.250% 09/09/2041 | EUR | 3.708.030,30 | 0,22 |
| 1.000.000 | NATURGY FINANCE BV 0.750% 28/11/2029 EMTN | EUR | 1.025.830,87 | 0,06 |
| 3.400.000 | NATURGY FINANCE BV 0.875% 15/05/2025 EMTN | EUR | 3.509.256,59 | 0,21 |
| 4.400.000 | NATURGY FINANCE BV 1.250% 15/01/2026 EMTN | EUR | 4.622.699,75 | 0,28 |
| 1.000.000 | NATURGY FINANCE BV 1.250% 19/04/2026 EMTN | EUR | 1.050.868,85 | 0,06 |
| 2.000.000 | NATURGY FINANCE BV 1.375% 19/01/2027 EMTN | EUR | 2.125.750,54 | 0,13 |
| 800.000 | NIBC BANK NV 0.875% 08/07/2025 EMTN | EUR | 822.990,67 | 0,05 |
| 650.000 | NIBC BANK NV 1.125% 19/04/2023 EMTN | EUR | 663.451,82 | 0,04 |
| 450.000 | NIBC BANK NV 1.500% 31/01/2022 EMTN | EUR | 452.668,48 | 0,03 |
| 7.446.000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN PERP | EUR | 7.467.609,04 | 0,45 |
| 2.000.000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.250% 02/08/2027 EMTN | EUR | 2.007.731,78 | 0,12 |
| 2.296.000 | SAGAX EURO MTN NL BV 0.750% 26/01/2028 EMTN | EUR | 2.281.816,64 | 0,14 |
| 170.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.000% 06/09/2027 EMTN | EUR | 179.853,25 | 0,01 |
| 1.495.000 | SIGNIFY NV 2.000% 11/05/2024 | EUR | 1.568.892,32 | 0,09 |
| 2.170.000 | SIGNIFY NV 2.375% 11/05/2027 | EUR | 2.395.258,11 | 0,14 |
| 5.850.000 | STELLANTIS NV 3.375% 07/07/2023 | EUR | 6.161.674,90 | 0,37 |
| 6.000.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 6.120.000,00 | 0,37 |
| 13.000.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 13.430.615,64 | 0,82 |
| 3.770.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 3.973.041,46 | 0,24 |
| 4.857.000 | VITERRA FINANCE BV 0.375% 24/09/2025 EMTN | EUR | 4.857.752,79 | 0,29 |
| 2.137.000 | VITERRA FINANCE BV 1.000% 24/09/2028 EMTN | EUR | 2.123.894,04 | 0,13 |
| 1.100.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.167.375,00 | 0,07 |
| 3.350.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 3.382.357,65 | 0,20 |
| 10.700.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 11.822.070,59 | 0,72 |
| 11.800.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 12.106.710,08 | 0,74 |
| 100.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 4.125% 16/11/2038 | EUR | 138.126,56 | 0,01 |
| 2.300.000 | VONOVIA FINANCE BV 0.625% 07/10/2027 EMTN | EUR | 2.330.997,77 | 0,14 |
| 1.500.000 | VONOVIA FINANCE BV 0.750% 15/01/2024 | EUR | 1.530.937,43 | 0,09 |
| 5.600.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN | EUR | 5.740.502,99 | 0,35 |
| 600.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.625% 07/10/2039 EMTN | EUR | 607.236,85 | 0,04 |
| 700.000 | VONOVIA FINANCE BV 2.250% 15/12/2023 EMTN | EUR | 737.889,81 | 0,04 |
| 600.000 | WOLTERS KLUWER NV 2.500% 13/05/2024 | EUR | 638.721,33 | 0,04 |
| 1.000.000 | WOLTERS KLUWER NV 2.875% 21/03/2023 | EUR | 1.046.803,71 | 0,06 |
| 1.200.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2.000% 23/02/2026 | EUR | 1.210.500,00 | 0,07 |
| | | | **317.769.178,40** | **19,21** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 2.649.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.400% 15/02/2027 | EUR | 2.640.178,33 | 0,16 |
| 5.000.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.875% 21/05/2029 | EUR | 5.029.271,60 | 0,30 |
| 3.818.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.950% 05/10/2030 | EUR | 3.802.416,87 | 0,23 |
| 2.515.000 | APPLE INC ZCP 15/11/2025 | EUR | 2.534.356,32 | 0,15 |
| 2.000.000 | AT&T INC 1.050% 05/09/2023 | EUR | 2.046.621,18 | 0,12 |
| 6.295.000 | AT&T INC 1.600% 19/05/2028 | EUR | 6.740.674,54 | 0,41 |
| 1.500.000 | AT&T INC 1.800% 05/09/2026 | EUR | 1.612.974,29 | 0,10 |
| 800.000 | AT&T INC 1.950% 15/09/2023 | EUR | 829.950,46 | 0,05 |
| 800.000 | AT&T INC 2.050% 19/05/2032 | EUR | 885.456,90 | 0,05 |
| 1.000.000 | AT&T INC 2.350% 05/09/2029 | EUR | 1.130.594,47 | 0,07 |
| 1.200.000 | AT&T INC 2.600% 17/12/2029 | EUR | 1.379.359,72 | 0,08 |
| 2.500.000 | AT&T INC 3.150% 04/09/2036 | EUR | 3.035.548,78 | 0,18 |
| 1.550.000 | AUTOLIV INC 0.750% 26/06/2023 | EUR | 1.571.235,91 | 0,09 |
| 3.645.000 | BANK OF AMERICA CORP 07/02/2025 FRN EMTN | EUR | 3.773.196,58 | 0,23 |
| 1.306.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/03/2031 FRN EMTN | EUR | 1.302.894,92 | 0,08 |
| 3.000.000 | BANK OF AMERICA CORP 24/08/2028 FRN EMTN | EUR | 3.029.737,95 | 0,18 |
| 1.000.000 | BANK OF AMERICA CORP 31/03/2029 FRN EMTN | EUR | 1.200.431,63 | 0,07 |
| 440.000 | BERKSHIRE HATHAWAY INC ZCP 12/03/2025 | EUR | 441.555,14 | 0,03 |
| 4.785.000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 1.250% 11/02/2025 | EUR | 4.953.957,82 | 0,30 |
| 350.000 | CHUBB INA HOLDINGS INC 0.300% 15/12/2024 | EUR | 353.509,55 | 0,02 |
| 2.000.000 | CITIGROUP INC 06/07/2026 FRN EMTN | EUR | 2.082.636,86 | 0,13 |
| 2.042.000 | CITIGROUP INC 08/10/2027 FRN EMTN | EUR | 2.059.625,67 | 0,12 |
| 1.800.000 | CITIGROUP INC 24/07/2026 FRN EMTN | EUR | 1.892.355,34 | 0,11 |
| 6.265.000 | COCA-COLA CO/THE 1.125% 09/03/2027 | EUR | 6.624.235,85 | 0,40 |
| 3.100.000 | DIGITAL EURO FINCO LLC 1.125% 09/04/2028 | EUR | 3.191.396,59 | 0,19 |
| 6.067.000 | ELI LILLY & CO 1.125% 14/09/2051 | EUR | 5.783.135,02 | 0,35 |
| 112.000 | EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033 | EUR | 111.322,34 | 0,01 |
| 9.586.000 | EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FUNDING 0.600% 16/06/2028 EMTN | EUR | 9.638.690,31 | 0,59 |
| 2.000.000 | GENERAL ELECTRIC CO 0.875% 17/05/2025 | EUR | 2.054.333,26 | 0,12 |
| 500.000 | GENERAL ELECTRIC CO 4.125% 19/09/2035 EMTN | EUR | 675.178,59 | 0,04 |
| 4.450.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.000% 18/03/2033 EMTN | EUR | 4.459.032,74 | 0,27 |
| 10.400.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 15/05/2024 EMTN | EUR | 10.653.126,43 | 0,65 |
| 8.000.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN | EUR | 8.016.648,08 | 0,48 |
| 3.335.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.300% 11/02/2028 | EUR | 3.344.192,76 | 0,20 |
| 3.500.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.950% 23/05/2025 | EUR | 3.629.804,78 | 0,22 |
| 4.000.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.250% 29/01/2027 | EUR | 4.234.356,72 | 0,26 |
| 810.000 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026 | EUR | 869.028,62 | 0,05 |
| 13.790.000 | JPMORGAN CHASE & CO 11/03/2027 FRN EMTN | EUR | 14.333.570,08 | 0,88 |
| 2.500.000 | JPMORGAN CHASE & CO 18/05/2028 FRN EMTN | EUR | 2.681.216,78 | 0,16 |
| 2.695.000 | JPMORGAN CHASE & CO 24/02/2028 FRN EMTN | EUR | 2.702.634,42 | 0,16 |
| 7.000.000 | MCDONALD'S CORP 0.250% 04/10/2028 GMTN | EUR | 6.941.163,11 | 0,42 |
| 2.500.000 | MMS USA HOLDINGS INC 0.625% 13/06/2025 | EUR | 2.548.953,88 | 0,15 |
| 4.600.000 | MORGAN STANLEY 1.750% 11/03/2024 GMTN | EUR | 4.816.961,90 | 0,29 |
| 4.000.000 | MORGAN STANLEY 1.750% 30/01/2025 GMTN | EUR | 4.239.072,52 | 0,26 |
| 1.322.000 | MORGAN STANLEY 23/10/2026 FRN EMTN | EUR | 1.387.116,96 | 0,08 |
| 6.900.000 | MORGAN STANLEY 29/10/2027 FRN | EUR | 6.941.074,32 | 0,42 |
| 555.000 | NASDAQ INC 0.875% 13/02/2030 | EUR | 563.359,23 | 0,03 |
| 9.295.000 | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 04/10/2028 GMTN | EUR | 9.258.803,88 | 0,56 |
| 9.822.000 | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 23/01/2027 GMTN | EUR | 9.905.926,63 | 0,61 |
| 11.745.000 | PARKER-HANNIFIN CORP 1.125% 01/03/2025 | EUR | 12.127.997,29 | 0,74 |
| 12.860.000 | PEPSICO INC 0.500% 06/05/2028 EMTN | EUR | 13.136.257,62 | 0,80 |
| 900.000 | PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.250% 10/09/2027 | EUR | 901.422,35 | 0,05 |
| 1.238.000 | PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.500% 16/02/2032 | EUR | 1.201.814,49 | 0,07 |
| 472.000 | PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.625% 10/09/2031 | EUR | 467.879,76 | 0,03 |
| 1.500.000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.950% 24/07/2029 | EUR | 1.662.683,66 | 0,10 |
| 2.500.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.750% 22/03/2032 | EUR | 2.473.700,58 | 0,15 |
| 2.000.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.875% 02/04/2025 | EUR | 2.065.193,38 | 0,12 |
| 2.338.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.875% 08/04/2027 | EUR | 2.420.099,06 | 0,15 |
| 3.887.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035 | EUR | 3.853.792,12 | 0,23 |
| 3.000.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030 | EUR | 3.165.084,96 | 0,19 |
| 2.000.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.300% 18/05/2033 | EUR | 2.075.476,64 | 0,13 |
| 2.566.000 | WELLS FARGO & CO 0.500% 26/04/2024 EMTN | EUR | 2.606.207,53 | 0,16 |
| 4.100.000 | WELLS FARGO & CO 1.000% 02/02/2027 EMTN | EUR | 4.246.231,13 | 0,26 |
| | | | **236.336.717,20** | **14,29** |
| | **Frankreich** | | | |
| 2.100.000 | ALSTOM SA ZCP 11/01/2029 | EUR | 2.036.528,82 | 0,12 |
| 300.000 | ARKEMA SA 3.125% 06/12/2023 EMTN | EUR | 317.701,76 | 0,02 |
| 7.600.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.010% 11/05/2026 EMTN | EUR | 7.579.147,12 | 0,46 |
| 1.600.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN | EUR | 1.591.549,62 | 0,10 |
| 2.200.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 19/07/2028 | EUR | 2.160.756,60 | 0,13 |
| 2.400.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 29/06/2028 EMTN | EUR | 2.393.991,65 | 0,14 |
| 9.200.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.625% 03/11/2028 EMTN | EUR | 9.256.320,38 | 0,57 |
| 4.500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN | EUR | 4.641.601,59 | 0,28 |
| 5.900.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 17/07/2025 EMTN | EUR | 6.079.410,33 | 0,37 |
| 300.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 24/03/2026 EMTN | EUR | 326.928,63 | 0,02 |
| 300.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.500% 25/05/2028 EMTN | EUR | 335.564,73 | 0,02 |
| 500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 3.000% 28/11/2023 EMTN | EUR | 536.028,27 | 0,03 |
| 2.100.000 | BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN | EUR | 2.131.112,87 | 0,13 |
| 818.000 | BNP PARIBAS SA 1.000% 17/04/2024 EMTN | EUR | 843.021,95 | 0,05 |
| 6.100.000 | BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN | EUR | 6.075.210,76 | 0,37 |
| 1.000.000 | BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN | EUR | 1.026.898,98 | 0,06 |
| 7.800.000 | BNP PARIBAS SA 15/01/2032 FRN EMTN | EUR | 7.913.209,04 | 0,48 |
| 500.000 | BNP PARIBAS SA 1.625% 02/07/2031 EMTN | EUR | 526.290,21 | 0,03 |
| 600.000 | BNP PARIBAS SA 19/01/2030 FRN EMTN | EUR | 591.376,90 | 0,04 |
| 1.200.000 | BNP PARIBAS SA 19/02/2028 FRN EMTN | EUR | 1.202.211,64 | 0,07 |
| 1.200.000 | BNP PARIBAS SA 20/11/2030 FRN EMTN | EUR | 1.290.533,15 | 0,08 |
| 5.400.000 | BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN | EUR | 5.818.993,88 | 0,35 |
| 1.200.000 | BPCE SA 0.125% 04/12/2024 | EUR | 1.212.184,62 | 0,07 |
| 1.400.000 | BPCE SA 0.250% 14/01/2031 | EUR | 1.357.818,94 | 0,08 |
| 2.000.000 | BPCE SA 0.250% 15/01/2026 | EUR | 2.017.428,24 | 0,12 |
| 4.500.000 | BPCE SA 0.375% 05/10/2023 EMTN | EUR | 4.565.816,91 | 0,28 |
| 3.600.000 | BPCE SA 0.625% 15/01/2030 | EUR | 3.643.953,84 | 0,22 |
| 3.500.000 | BPCE SA 0.625% 28/04/2025 | EUR | 3.581.788,74 | 0,22 |
| 1.700.000 | BPCE SA 30/11/2027 FRN EMTN | EUR | 1.754.544,48 | 0,11 |
| 800.000 | CAPGEMINI SE 2.500% 01/07/2023 | EUR | 833.334,26 | 0,05 |
| 4.000.000 | CARREFOUR SA 2.625% 15/12/2027 EMTN | EUR | 4.565.193,28 | 0,28 |
| 7.400.000 | CCR RE SA 15/07/2040 FRN | EUR | 8.104.012,69 | 0,49 |
| 2.700.000 | CIE DE SAINT-GOBAIN 2.375% 04/10/2027 | EUR | 3.050.702,41 | 0,18 |
| 900.000 | COVIVIO 1.625% 23/06/2030 | EUR | 974.559,63 | 0,06 |
| 600.000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA 27/09/2048 FRN | EUR | 735.594,86 | 0,04 |
| 1.400.000 | CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 20/04/2028 EMTN | EUR | 1.387.202,45 | 0,08 |
| 1.900.000 | CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 21/10/2025 EMTN | EUR | 1.924.708,06 | 0,12 |
| 600.000 | CREDIT AGRICOLE SA 05/06/2030 FRN EMTN | EUR | 624.383,46 | 0,04 |
| 3.200.000 | CREDIT AGRICOLE SA 2.000% 25/03/2029 EMTN | EUR | 3.460.002,27 | 0,21 |
| 700.000 | CREDIT AGRICOLE SA 21/09/2029 FRN EMTN | EUR | 695.201,84 | 0,04 |
| 6.000.000 | CREDIT AGRICOLE SA 22/04/2026 FRN EMTN | EUR | 6.186.098,88 | 0,37 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.300.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 0.500% 24/06/2024 EMTN | EUR | 1.323.165,86 | 0,08 |
| 1.400.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.000% 03/07/2029 EMTN | EUR | 1.474.583,28 | 0,09 |
| 1.000.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.250% 14/04/2026 EMTN | EUR | 1.057.811,52 | 0,06 |
| 1.900.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 03/05/2027 EMTN | EUR | 2.030.897,25 | 0,12 |
| 2.000.000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.010% 28/01/2026 EMTN | EUR | 1.996.582,38 | 0,12 |
| 1.900.000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.875% 07/05/2027 EMTN | EUR | 1.968.238,18 | 0,12 |
| 600.000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 25/10/2029 FRN EMTN | EUR | 626.332,38 | 0,04 |
| 4.100.000 | ELO SACA 2.875% 29/01/2026 EMTN | EUR | 4.526.272,12 | 0,27 |
| 5.300.000 | ESSILORLUXOTTICA SA 0.125% 27/05/2025 EMTN | EUR | 5.360.476,29 | 0,32 |
| 900.000 | EUTELSAT SA 1.500% 13/10/2028 | EUR | 917.096,46 | 0,06 |
| 10.600.000 | FAURECIA SE 3.125% 15/06/2026 | EUR | 10.851.329,92 | 0,67 |
| 2.105.000 | FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.375% 30/10/2026 | EUR | 2.239.350,87 | 0,14 |
| 3.900.000 | HOLDING D'INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT SASU 0.625% 14/09/2028 EMTN | EUR | 3.867.115,04 | 0,23 |
| 2.000.000 | HOLDING D'INFRASTRUCTURES DE TRANSPORT SASU 0.625% 27/03/2023 EMTN | EUR | 2.018.878,88 | 0,12 |
| 2.900.000 | HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.100% 03/09/2027 EMTN | EUR | 2.877.887,30 | 0,17 |
| 500.000 | HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.250% 17/05/2024 EMTN | EUR | 506.613,04 | 0,03 |
| 2.200.000 | ICADE SANTE SAS 1.375% 17/09/2030 | EUR | 2.305.427,52 | 0,14 |
| 5.000.000 | IMERYS SA 1.500% 15/01/2027 EMTN | EUR | 5.280.952,85 | 0,32 |
| 3.200.000 | ORANGE SA FRN PERP | EUR | 3.556.000,00 | 0,22 |
| 200.000 | ORANGE SA FRN PERP EMTN | EUR | 237.568,04 | 0,01 |
| 2.000.000 | ORANGE SA ZCP 04/09/2026 EMTN | EUR | 1.997.755,44 | 0,12 |
| 2.500.000 | ORANGE SA 1.125% 15/07/2024 EMTN | EUR | 2.586.842,03 | 0,16 |
| 7.200.000 | ORANGE SA 1.625% 07/04/2032 EMTN | EUR | 7.970.495,47 | 0,48 |
| 2.000.000 | PSA BANQUE FRANCE SA 0.625% 21/06/2024 | EUR | 2.033.953,32 | 0,12 |
| 1.250.000 | PSA BANQUE FRANCE SA 0.750% 19/04/2023 EMTN | EUR | 1.267.761,76 | 0,08 |
| 2.470.000 | RCI BANQUE SA 0.750% 10/04/2023 EMTN | EUR | 2.495.467,92 | 0,15 |
| 2.319.000 | RCI BANQUE SA 1.375% 08/03/2024 EMTN | EUR | 2.389.631,94 | 0,14 |
| 5.730.000 | RCI BANQUE SA 2.000% 11/07/2024 EMTN | EUR | 6.006.829,14 | 0,36 |
| 2.200.000 | SOCIETE GENERALE SA 1.250% 12/06/2030 | EUR | 2.265.443,00 | 0,14 |
| 5.400.000 | SOCIETE GENERALE SA 21/04/2026 FRN EMTN | EUR | 5.571.979,47 | 0,34 |
| 1.700.000 | TEREGA SA 0.875% 17/09/2030 | EUR | 1.711.445,71 | 0,10 |
| 1.600.000 | TEREGA SASU 0.625% 27/02/2028 | EUR | 1.592.073,70 | 0,10 |
| 2.400.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 2.529.496,92 | 0,15 |
| 2.500.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 2.584.375,00 | 0,16 |
| 3.000.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 3.065.929,83 | 0,19 |
| 6.910.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 7.074.975,97 | 0,43 |
| 700.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE FRN PERP | EUR | 698.368,57 | 0,04 |
| 2.200.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 0.875% 29/03/2032 EMTN | EUR | 2.167.694,58 | 0,13 |
| 2.300.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.375% 04/12/2031 EMTN | EUR | 2.386.686,70 | 0,14 |
| 100.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 2.250% 14/05/2038 EMTN | EUR | 110.525,93 | 0,01 |
| 2.000.000 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA FRN PERP | EUR | 2.055.000,00 | 0,12 |
| 2.000.000 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 0.800% 15/01/2032 EMTN | EUR | 2.019.436,26 | 0,12 |
| 1.000.000 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA 1.250% 15/04/2028 EMTN | EUR | 1.063.191,36 | 0,06 |
| 990.000 | WPP FINANCE SA 2.375% 19/05/2027 EMTN | EUR | 1.105.908,52 | 0,07 |
| | | | **235.122.766,46** | **14,22** |
| | **Deutschland** | | | |
| 5.150.000 | ALBEMARLE NEW HOLDING GMBH 1.625% 25/11/2028 | EUR | 5.512.316,71 | 0,33 |
| 900.000 | ALSTRIA OFFICE REIT-AG 1.500% 15/11/2027 | EUR | 936.424,20 | 0,06 |
| 9.400.000 | BAYER AG 0.750% 06/01/2027 | EUR | 9.587.135,29 | 0,58 |
| 866.000 | COMMERZBANK AG 0.500% 04/12/2026 EMTN | EUR | 878.349,87 | 0,05 |
| 1.300.000 | COMMERZBANK AG 0.875% 22/01/2027 EMTN | EUR | 1.319.398,61 | 0,08 |
| 1.800.000 | COMMERZBANK AG 1.000% 04/03/2026 EMTN | EUR | 1.868.633,89 | 0,11 |
| 2.199.000 | COVESTRO AG 0.875% 03/02/2026 EMTN | EUR | 2.268.577,83 | 0,14 |
| 323.000 | COVESTRO AG 1.375% 12/06/2030 EMTN | EUR | 344.725,37 | 0,02 |
| 988.000 | DEUTSCHE BANK AG 10/06/2026 FRN EMTN | EUR | 1.035.945,93 | 0,06 |
| 2.700.000 | DEUTSCHE BANK AG 1.625% 20/01/2027 EMTN | EUR | 2.843.565,40 | 0,17 |
| 1.400.000 | DEUTSCHE BANK AG 17/02/2032 FRN | EUR | 1.418.538,37 | 0,09 |
| 800.000 | DEUTSCHE BANK AG 19/11/2030 FRN EMTN | EUR | 842.671,22 | 0,05 |
| 1.415.000 | E.ON SE 1.000% 07/10/2025 EMTN | EUR | 1.470.743,33 | 0,09 |
| 3.400.000 | EUROGRID GMBH 1.500% 18/04/2028 EMTN | EUR | 3.663.325,04 | 0,22 |
| 2.400.000 | EUROGRID GMBH 1.875% 10/06/2025 EMTN | EUR | 2.559.464,66 | 0,15 |
| 1.000.000 | EVONIK INDUSTRIES AG 02/09/2081 FRN | EUR | 1.001.250,00 | 0,06 |
| 3.260.000 | HEIDELBERGCEMENT AG 1.500% 07/02/2025 EMTN | EUR | 3.415.729,61 | 0,21 |
| 8.041.000 | LANXESS AG ZCP 08/09/2027 EMTN | EUR | 7.925.931,92 | 0,48 |
| 21.064.000 | MAHLE GMBH 2.375% 20/05/2022 EMTN | EUR | 21.340.719,03 | 1,28 |
| 2.000.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2042 FRN EMTN | EUR | 2.079.620,12 | 0,13 |
| 5.500.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2042 FRN EMTN | GBP | 6.637.894,74 | 0,40 |
| 5.400.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2049 FRN | EUR | 6.231.117,19 | 0,38 |
| 3.800.000 | O2 TELEFONICA DEUTSCHLAND FINANZIERUNGS GMBH 1.750% 05/07/2025 | EUR | 4.012.904,39 | 0,24 |
| 13.500.000 | SCHAEFFLER AG 2.750% 12/10/2025 EMTN | EUR | 14.375.265,75 | 0,86 |
| 700.000 | SCHAEFFLER AG 2.875% 26/03/2027 EMTN | EUR | 759.706,81 | 0,05 |
| 200.000 | SCHAEFFLER AG 3.375% 12/10/2028 EMTN | EUR | 224.000,00 | 0,01 |
| 2.565.000 | SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025 | EUR | 2.682.764,05 | 0,16 |
| 3.063.000 | SYMRISE AG 1.375% 01/07/2027 | EUR | 3.231.101,73 | 0,20 |
| 800.000 | VANTAGE TOWERS AG 0.375% 31/03/2027 EMTN | EUR | 799.678,44 | 0,05 |
| 5.800.000 | VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.875% 31/01/2024 EMTN | EUR | 6.055.094,90 | 0,37 |
| 3.100.000 | VOLKSWAGEN BANK GMBH 2.500% 31/07/2026 EMTN | EUR | 3.425.721,28 | 0,21 |
| 8.230.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 3.375% 06/04/2028 EMTN | EUR | 9.689.199,74 | 0,59 |
| 3.000.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH ZCP 19/07/2024 EMTN | EUR | 2.999.593,59 | 0,18 |
| 2.800.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.375% 20/07/2026 EMTN | EUR | 2.806.734,11 | 0,17 |
| 5.076.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.625% 19/07/2029 EMTN | EUR | 5.048.983,35 | 0,31 |
| 1.000.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.000% 16/02/2023 EMTN | EUR | 1.016.147,82 | 0,06 |
| 15.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.125% 04/04/2024 EMTN | EUR | 15.421,78 | 0,00 |
| 4.396.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.500% 19/06/2026 EMTN | EUR | 4.644.477,13 | 0,28 |
| 1.750.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.625% 15/08/2025 EMTN | EUR | 1.846.941,37 | 0,11 |
| 200.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 2.375% 06/09/2022 EMTN | EUR | 204.973,63 | 0,01 |
| 3.200.000 | VONOVIA SE 0.250% 01/09/2028 EMTN | EUR | 3.143.176,38 | 0,19 |
| 5.400.000 | VONOVIA SE 0.625% 14/12/2029 EMTN | EUR | 5.398.166,11 | 0,33 |
| 4.100.000 | VONOVIA SE 0.750% 01/09/2032 EMTN | EUR | 3.996.588,57 | 0,24 |
| 1.500.000 | VONOVIA SE 1.000% 16/06/2033 | EUR | 1.491.663,80 | 0,09 |
| 1.500.000 | ZF FINANCE GMBH 3.000% 21/09/2025 EMTN | EUR | 1.578.750,00 | 0,10 |
| | | | **164.629.133,06** | **9,95** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 5.500.000 | ARCELORMITTAL SA 1.750% 19/11/2025 EMTN | EUR | 5.791.212,08 | 0,35 |
| 400.000 | AROUNDTOWN SA 1.450% 09/07/2028 EMTN | EUR | 418.403,66 | 0,03 |
| 500.000 | AROUNDTOWN SA 1.625% 31/01/2028 EMTN | EUR | 528.154,70 | 0,03 |
| 300.000 | AROUNDTOWN SA 1.875% 19/01/2026 EMTN | EUR | 320.937,38 | 0,02 |
| 2.000.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.625% 03/07/2029 EMTN | EUR | 2.125.404,74 | 0,13 |
| 1.410.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.750% 25/03/2027 EMTN | EUR | 1.505.548,96 | 0,09 |
| 2.800.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN | EUR | 2.986.290,33 | 0,18 |
| 7.895.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031 | EUR | 7.956.192,17 | 0,49 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.200.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA FRN PERP EMTN | EUR | 2.167.000,00 | 0,13 |
| 3.300.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 0.125% 11/01/2028 EMTN | EUR | 3.192.226,09 | 0,19 |
| 1.900.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 1.375% 03/08/2026 EMTN | EUR | 1.994.640,43 | 0,12 |
| 1.100.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 1.500% 22/02/2027 EMTN | EUR | 1.161.142,28 | 0,07 |
| 2.400.000 | HANNOVER FINANCE LUXEMBOURG SA 30/06/2043 FRN | EUR | 2.602.782,17 | 0,16 |
| 2.329.000 | HARMAN FINANCE INTERNATIONAL SCA 2.000% 27/05/2022 | EUR | 2.350.557,50 | 0,14 |
| 1.702.000 | HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.125% 01/12/2027 EMTN | EUR | 1.782.162,99 | 0,11 |
| 5.540.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA FRN PERP | EUR | 5.796.225,00 | 0,35 |
| 1.976.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 23/04/2031 | EUR | 1.916.734,66 | 0,12 |
| 2.660.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 29/11/2026 EMTN | EUR | 2.705.421,50 | 0,16 |
| 2.727.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.625% 19/01/2033 EMTN | EUR | 2.613.389,33 | 0,16 |
| 1.000.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 1.750% 29/08/2029 EMTN | EUR | 1.089.311,41 | 0,07 |
| 1.456.000 | JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN | EUR | 1.710.626,87 | 0,10 |
| 2.334.000 | LOGICOR FINANCING SARL 0.875% 14/01/2031 EMTN | EUR | 2.258.087,28 | 0,14 |
| 7.302.000 | LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15/07/2027 EMTN | EUR | 7.688.161,38 | 0,46 |
| 200.000 | LOGICOR FINANCING SARL 2.250% 13/05/2025 EMTN | EUR | 213.655,63 | 0,01 |
| 800.000 | LOGICOR FINANCING SARL 3.250% 13/11/2028 EMTN | EUR | 925.167,29 | 0,06 |
| 7.630.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.375% 15/10/2028 | EUR | 7.672.740,59 | 0,46 |
| 1.875.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.750% 15/10/2032 | EUR | 1.887.273,71 | 0,11 |
| 974.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 2.250% 07/03/2039 | EUR | 1.130.871,94 | 0,07 |
| 200.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 0.875% 09/07/2029 EMTN | EUR | 205.484,81 | 0,01 |
| 268.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN | EUR | 287.556,00 | 0,02 |
| 6.600.000 | REPSOL EUROPE FINANCE SARL 0.875% 06/07/2033 EMTN | EUR | 6.580.240,72 | 0,40 |
| 1.409.000 | SEGRO CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031 | EUR | 1.379.011,70 | 0,08 |
| 945.000 | SELP FINANCE SARL 1.500% 20/12/2026 | EUR | 994.244,71 | 0,06 |
| 5.067.000 | SES SA 1.625% 22/03/2026 EMTN | EUR | 5.376.462,92 | 0,33 |
| 2.000.000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 0.125% 24/03/2025 EMTN | EUR | 2.001.250,80 | 0,12 |
| 900.000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN | EUR | 906.942,28 | 0,05 |
| | | | **92.221.516,01** | **5,58** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 820.000 | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1.625% 11/03/2026 EMTN | EUR | 863.312,14 | 0,05 |
| 1.430.000 | AVIVA PLC 03/07/2044 FRN EMTN | EUR | 1.568.671,62 | 0,09 |
| 10.440.000 | AVIVA PLC 04/12/2045 FRN EMTN | EUR | 11.593.925,16 | 0,70 |
| 900.000 | BARCLAYS PLC 02/04/2025 FRN EMTN | EUR | 974.265,73 | 0,06 |
| 1.200.000 | BARCLAYS PLC 07/02/2028 FRN EMTN | EUR | 1.228.248,67 | 0,07 |
| 2.450.000 | BARCLAYS PLC 09/06/2025 FRN EMTN | EUR | 2.494.552,47 | 0,15 |
| 1.200.000 | BARCLAYS PLC 09/08/2029 FRN | EUR | 1.185.974,75 | 0,07 |
| 1.195.000 | BP CAPITAL MARKETS PLC 1.231% 08/05/2031 EMTN | EUR | 1.246.670,08 | 0,08 |
| 1.000.000 | BP CAPITAL MARKETS PLC 1.953% 03/03/2025 EMTN | EUR | 1.068.865,37 | 0,06 |
| 4.600.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 1.500% 08/11/2027 | EUR | 4.921.862,18 | 0,30 |
| 1.600.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 1.750% 27/03/2026 | EUR | 1.717.224,96 | 0,10 |
| 1.003.000 | DIAGEO FINANCE PLC 1.000% 22/04/2025 EMTN | EUR | 1.042.171,83 | 0,06 |
| 2.000.000 | FCE BANK PLC 1.134% 10/02/2022 EMTN | EUR | 2.007.168,06 | 0,12 |
| 7.450.000 | FCE BANK PLC 1.615% 11/05/2023 EMTN | EUR | 7.591.194,11 | 0,46 |
| 1.000.000 | FCE BANK PLC 2.727% 03/06/2022 EMTN | GBP | 1.175.514,85 | 0,07 |
| 3.263.000 | HSBC HOLDINGS PLC 24/09/2029 FRN | EUR | 3.249.497,05 | 0,20 |
| 1.500.000 | HSBC HOLDINGS PLC 3.000% 30/06/2025 EMTN | EUR | 1.652.368,40 | 0,10 |
| 616.000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0.375% 28/01/2025 EMTN | EUR | 624.369,41 | 0,04 |
| 2.200.000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 2.375% 09/04/2026 EMTN | EUR | 2.424.163,35 | 0,15 |
| 600.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 01/04/2026 FRN EMTN | EUR | 671.502,01 | 0,04 |
| 1.000.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 12/11/2025 FRN EMTN | EUR | 1.014.377,26 | 0,06 |
| 1.500.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 15/01/2024 FRN EMTN | EUR | 1.515.888,41 | 0,09 |
| 400.000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 25/07/2029 FRN EMTN | EUR | 419.294,40 | 0,03 |
| 400.000 | NATWEST GROUP PLC 02/03/2026 FRN EMTN | EUR | 421.015,80 | 0,03 |
| 1.757.000 | NATWEST GROUP PLC 04/03/2025 FRN EMTN | EUR | 1.841.016,00 | 0,11 |
| 545.000 | NATWEST GROUP PLC 14/09/2032 FRN EMTN | EUR | 543.380,82 | 0,03 |
| 2.419.000 | NATWEST GROUP PLC 26/02/2030 FRN EMTN | EUR | 2.417.708,74 | 0,15 |
| 3.110.000 | NATWEST MARKETS PLC 0.125% 18/06/2026 EMTN | EUR | 3.096.820,63 | 0,19 |
| 1.900.000 | NATWEST MARKETS PLC 2.750% 02/04/2025 EMTN | EUR | 2.082.981,95 | 0,13 |
| 4.700.000 | RENTOKIL INITIAL PLC 0.500% 14/10/2028 EMTN | EUR | 4.727.415,34 | 0,29 |
| 900.000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.125% 08/09/2023 | EUR | 922.956,19 | 0,06 |
| 2.063.000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 13/09/2029 FRN EMTN | EUR | 2.040.397,88 | 0,12 |
| 1.170.000 | STANDARD CHARTERED PLC 09/09/2030 FRN | EUR | 1.237.227,49 | 0,07 |
| 7.695.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN | EUR | 7.911.473,97 | 0,48 |
| 4.200.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.750% 27/04/2030 EMTN | GBP | 5.127.455,76 | 0,31 |
| | | | **84.620.932,84** | **5,12** |
| | **Japan** | | | |
| 5.600.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.155% 23/10/2024 | EUR | 5.635.498,85 | 0,34 |
| 9.103.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.336% 19/04/2027 | EUR | 9.137.738,69 | 0,55 |
| 4.000.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.541% 23/10/2028 | EUR | 4.026.425,88 | 0,24 |
| 2.800.000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.339% 19/07/2024 | EUR | 2.837.501,58 | 0,17 |
| 170.000 | NISSAN MOTOR CO LTD 2.652% 17/03/2026 | EUR | 184.513,43 | 0,01 |
| 710.000 | NISSAN MOTOR CO LTD 3.201% 17/09/2028 | EUR | 797.872,80 | 0,05 |
| 16.000.000 | SOFTBANK GROUP CORP 3.375% 06/07/2029 | EUR | 15.165.477,12 | 0,93 |
| 1.000.000 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 0.632% 23/10/2029 EMTN | EUR | 1.003.189,35 | 0,06 |
| 6.922.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 0.750% 09/07/2027 | EUR | 7.114.297,38 | 0,43 |
| 3.000.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.000% 09/07/2029 | EUR | 3.100.501,35 | 0,19 |
| 3.243.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.375% 09/07/2032 | EUR | 3.389.949,31 | 0,20 |
| 13.075.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.250% 21/11/2026 | EUR | 14.412.207,45 | 0,87 |
| 3.200.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030 | EUR | 3.827.886,88 | 0,23 |
| | | | **70.633.060,07** | **4,27** |
| | **Spanien** | | | |
| 1.300.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 0.625% 15/07/2025 EMTN | EUR | 1.324.375,57 | 0,08 |
| 4.000.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 1.625% 15/07/2029 EMTN | EUR | 4.212.398,40 | 0,25 |
| 600.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 2.375% 27/09/2027 EMTN | EUR | 660.127,54 | 0,04 |
| 4.500.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 3.000% 27/03/2031 EMTN | EUR | 5.249.667,15 | 0,32 |
| 900.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 04/06/2025 FRN GMTN | EUR | 926.208,39 | 0,06 |
| 400.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.375% 14/05/2025 GMTN | EUR | 419.622,57 | 0,03 |
| 800.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 16/01/2030 FRN GMTN | EUR | 809.327,91 | 0,05 |
| 1.200.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 24/03/2027 FRN GMTN | EUR | 1.197.801,68 | 0,07 |
| 200.000 | BANCO DE SABADELL SA 0.875% 22/07/2025 EMTN | EUR | 204.296,45 | 0,01 |
| 2.300.000 | BANCO DE SABADELL SA 1.625% 07/03/2024 EMTN | EUR | 2.390.233,16 | 0,14 |
| 1.900.000 | BANCO SANTANDER SA 0.200% 11/02/2028 EMTN | EUR | 1.884.523,32 | 0,11 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.600.000 | BANCO SANTANDER SA 0.250% 19/06/2024 EMTN | EUR | 1.618.232,64 | 0,10 |
| 1.400.000 | BANCO SANTANDER SA 24/06/2029 FRN EMTN | EUR | 1.403.506,45 | 0,08 |
| 500.000 | CAIXABANK SA 0.375% 03/02/2025 EMTN | EUR | 506.563,57 | 0,03 |
| 1.700.000 | CAIXABANK SA 0.750% 09/07/2026 | EUR | 1.745.433,52 | 0,11 |
| 900.000 | CAIXABANK SA 0.750% 18/04/2023 EMTN | EUR | 914.302,36 | 0,06 |
| 1.600.000 | CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN | EUR | 1.579.595,31 | 0,10 |
| 3.400.000 | CAIXABANK SA 10/07/2026 FRN EMTN | EUR | 3.478.450,95 | 0,21 |
| 5.100.000 | CAIXABANK SA 1.125% 17/05/2024 EMTN | EUR | 5.267.693,87 | 0,32 |
| 4.500.000 | CAIXABANK SA 1.125% 27/03/2026 EMTN | EUR | 4.696.180,52 | 0,28 |
| 1.900.000 | CAIXABANK SA 14/07/2028 FRN EMTN | EUR | 1.981.163,44 | 0,12 |
| 1.500.000 | CAIXABANK SA 17/04/2030 FRN EMTN | EUR | 1.579.658,51 | 0,10 |
| 700.000 | CAIXABANK SA 1.750% 24/10/2023 EMTN | EUR | 727.440,73 | 0,04 |
| 2.000.000 | CAIXABANK SA 18/06/2031 FRN EMTN | EUR | 2.024.741,14 | 0,12 |
| 3.000.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 1.250% 28/10/2026 EMTN | EUR | 3.187.438,59 | 0,19 |
| 500.000 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 1.875% 04/12/2034 | EUR | 498.705,99 | 0,03 |
| 100.000 | RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU 0.375% 24/07/2028 EMTN | EUR | 101.676,56 | 0,01 |
| 500.000 | RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU 1.250% 13/03/2027 EMTN | EUR | 531.470,98 | 0,03 |
| 600.000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.375% 27/06/2024 EMTN | EUR | 608.011,09 | 0,04 |
| 1.600.000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.500% 14/11/2026 EMTN | EUR | 1.624.322,08 | 0,10 |
| | | | **53.353.170,44** | **3,23** |
| | **Italien** | | | |
| 2.500.000 | AEROPORTI DI ROMA SPA 1.625% 02/02/2029 EMTN | EUR | 2.618.328,60 | 0,16 |
| 4.000.000 | ENEL SPA FRN PERP | EUR | 4.422.404,12 | 0,27 |
| 1.300.000 | ENEL SPA 24/05/2080 FRN | EUR | 1.415.042,63 | 0,09 |
| 3.000.000 | ENEL SPA 24/11/2078 FRN PERP | EUR | 3.126.963,81 | 0,19 |
| 2.523.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.125% 16/11/2023 EMTN | EUR | 2.533.133,91 | 0,15 |
| 2.947.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.250% 28/02/2023 EMTN | EUR | 2.963.542,87 | 0,18 |
| 2.130.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.500% 18/09/2023 EMTN | EUR | 2.152.101,03 | 0,13 |
| 460.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.625% 24/11/2022 EMTN | EUR | 464.187,43 | 0,03 |
| 4.700.000 | INTESA SANPAOLO SPA 04/03/2029 FRN EMTN | EUR | 5.261.767,27 | 0,32 |
| 1.197.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 04/12/2024 EMTN | EUR | 1.226.622,34 | 0,07 |
| 1.100.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN | EUR | 1.113.637,49 | 0,07 |
| 1.000.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.000% 04/07/2024 EMTN | EUR | 1.029.181,06 | 0,06 |
| 3.600.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.000% 19/11/2026 EMTN | EUR | 3.713.394,78 | 0,22 |
| 3.700.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.750% 04/07/2029 EMTN | EUR | 3.982.940,48 | 0,24 |
| 750.000 | INTESA SANPAOLO SPA 4.000% 23/09/2029 | USD | 707.088,93 | 0,04 |
| 850.000 | MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.000% 08/09/2027 EMTN | EUR | 873.378,00 | 0,05 |
| 2.717.000 | UNICREDIT SPA 05/07/2029 FRN EMTN | EUR | 2.748.558,80 | 0,17 |
| 2.500.000 | UNICREDIT SPA 0.850% 19/01/2031 EMTN | EUR | 2.464.917,48 | 0,15 |
| 1.813.000 | UNICREDIT SPA 16/06/2026 FRN EMTN | EUR | 1.875.043,85 | 0,11 |
| 1.400.000 | UNICREDIT SPA 22/07/2027 FRN EMTN | EUR | 1.496.899,38 | 0,09 |
| 3.045.000 | UNICREDIT SPA 25/06/2025 FRN EMTN | EUR | 3.138.176,91 | 0,19 |
| | | | **49.327.311,17** | **2,98** |
| | **Irland** | | | |
| 1.500.000 | AIB GROUP PLC 1.250% 28/05/2024 EMTN | EUR | 1.551.938,24 | 0,09 |
| 1.576.000 | AIB GROUP PLC 17/11/2027 FRN EMTN | EUR | 1.582.243,34 | 0,10 |
| 447.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 08/07/2024 FRN EMTN | EUR | 453.488,41 | 0,03 |
| 1.634.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 10/05/2027 FRN EMTN | EUR | 1.627.888,77 | 0,10 |
| 1.362.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 1.375% 29/08/2023 EMTN | EUR | 1.400.732,39 | 0,08 |
| 400.000 | CRH FINANCE DAC 3.125% 03/04/2023 | EUR | 420.253,40 | 0,03 |
| 2.800.000 | CRH SMW FINANCE DAC 1.250% 05/11/2026 EMTN | EUR | 2.959.060,78 | 0,18 |
| 3.284.000 | FRESENIUS FINANCE IRELAND PLC 0.875% 01/10/2031 EMTN | EUR | 3.262.839,12 | 0,20 |
| 1.550.000 | GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING UNLIMITED CO 4.625% 22/02/2027 EMTN | EUR | 1.902.407,80 | 0,12 |
| 918.000 | HAMMERSON IRELAND FINANCE DAC 1.750% 03/06/2027 | EUR | 928.355,08 | 0,06 |
| 2.255.000 | KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 0.625% 20/09/2029 | EUR | 2.270.594,25 | 0,14 |
| 7.000.000 | KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 2.375% 10/09/2025 | EUR | 7.634.657,03 | 0,45 |
| 13.727.000 | PARTNERRE IRELAND FINANCE DAC 1.250% 15/09/2026 | EUR | 14.340.586,60 | 0,86 |
| 3.000.000 | SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC 2.875% 15/01/2026 | EUR | 3.320.754,90 | 0,20 |
| 2.795.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033 | EUR | 2.779.631,27 | 0,17 |
| 1.700.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.500% 15/09/2027 | EUR | 1.804.765,20 | 0,11 |
| | | | **48.240.196,58** | **2,92** |
| | **Schweiz** | | | |
| 1.400.000 | CREDIT SUISSE AG/LONDON 0.250% 01/09/2028 EMTN | EUR | 1.369.051,35 | 0,08 |
| 1.500.000 | CREDIT SUISSE AG/LONDON 1.500% 10/04/2026 EMTN | EUR | 1.586.318,85 | 0,10 |
| 8.013.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 02/04/2026 FRN EMTN | EUR | 8.830.815,99 | 0,53 |
| 473.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 0.650% 10/09/2029 EMTN | EUR | 466.411,23 | 0,03 |
| 4.950.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 14/01/2028 FRN EMTN | EUR | 4.950.503,66 | 0,30 |
| 3.900.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 17/07/2025 FRN EMTN | EUR | 4.013.629,89 | 0,24 |
| 2.300.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 24/06/2027 FRN EMTN | EUR | 2.357.101,80 | 0,14 |
| 11.441.000 | UBS AG/LONDON 0.010% 31/03/2026 EMTN | EUR | 11.412.602,87 | 0,69 |
| 7.100.000 | UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN | EUR | 7.039.916,11 | 0,43 |
| 1.800.000 | UBS GROUP AG 29/01/2026 FRN EMTN | EUR | 1.811.603,05 | 0,11 |
| | | | **43.837.954,80** | **2,65** |
| | **Finnland** | | | |
| 2.880.000 | ELENIA VERKKO OYJ 0.375% 06/02/2027 EMTN | EUR | 2.893.082,34 | 0,17 |
| 6.500.000 | FINGRID OYJ 3.500% 03/04/2024 EMTN | EUR | 7.105.493,33 | 0,43 |
| 525.000 | KOJAMO OYJ 1.875% 27/05/2027 EMTN | EUR | 563.945,08 | 0,03 |
| 1.630.000 | METSO OUTOTEC OYJ 0.875% 26/05/2028 EMTN | EUR | 1.654.272,67 | 0,10 |
| 1.300.000 | OP CORPORATE BANK PLC 0.100% 16/11/2027 EMTN | EUR | 1.293.031,74 | 0,08 |
| 6.000.000 | OP CORPORATE BANK PLC 0.125% 01/07/2024 EMTN | EUR | 6.059.562,66 | 0,37 |
| 5.318.000 | OP CORPORATE BANK PLC 09/06/2030 FRN | EUR | 5.508.916,63 | 0,33 |
| 4.328.000 | SAMPO OYJ 03/09/2052 FRN EMTN | EUR | 4.599.137,73 | 0,28 |
| 4.739.000 | SAMPO OYJ 23/05/2049 FRN | EUR | 5.402.829,12 | 0,33 |
| 1.200.000 | SATO OYJ 1.375% 24/02/2028 | EUR | 1.248.224,14 | 0,08 |
| 639.000 | STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN | EUR | 639.361,39 | 0,04 |
| 4.555.000 | UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN | EUR | 4.478.646,13 | 0,27 |
| | | | **41.446.502,96** | **2,51** |
| | **Schweden** | | | |
| 645.000 | ATLAS COPCO AB 0.625% 30/08/2026 EMTN | EUR | 665.478,02 | 0,04 |
| 1.000.000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.125% 29/01/2027 EMTN | EUR | 1.021.969,65 | 0,06 |
| 300.000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.250% 28/01/2028 EMTN | EUR | 304.941,31 | 0,02 |
| 550.000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.875% 23/01/2026 | EUR | 581.164,30 | 0,04 |
| 2.600.000 | HEIMSTADEN BOSTAD AB FRN PERP | EUR | 2.535.813,72 | 0,15 |
| 7.750.000 | SCANIA CV AB 2.250% 03/06/2025 EMTN | EUR | 8.350.205,88 | 0,51 |
| 1.500.000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 0.050% 01/07/2024 EMTN | EUR | 1.513.549,91 | 0,09 |
| 1.700.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.125% 18/06/2024 EMTN | EUR | 1.720.467,93 | 0,10 |
| 5.300.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 02/03/2028 FRN EMTN | EUR | 5.398.120,70 | 0,33 |
| 1.958.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.000% 15/04/2025 EMTN | EUR | 2.039.976,74 | 0,12 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 4.473.000 | TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON 1.00% 26/05/2029 EMTN | EUR | 4.501.813,32 | 0,27 |
| | | | **28.633.501,48** | **1,73** |
| | **Belgien** | | | |
| 1.405.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 1.150% 22/01/2027 EMTN | EUR | 1.478.974,09 | 0,09 |
| 1.000.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN | EUR | 1.196.054,50 | 0,07 |
| 7.070.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.875% 02/04/2032 EMTN | EUR | 8.525.450,56 | 0,52 |
| 2.500.000 | BELFIUS BANK SA 0.010% 15/10/2025 EMTN | EUR | 2.501.906,65 | 0,15 |
| 1.000.000 | KBC GROUP NV 03/12/2029 FRN EMTN | EUR | 1.003.881,32 | 0,06 |
| 5.000.000 | KBC GROUP NV 07/12/2031 FRN EMTN | EUR | 4.971.733,40 | 0,30 |
| 600.000 | KBC GROUP NV 18/09/2029 FRN EMTN | EUR | 623.832,00 | 0,04 |
| 1.700.000 | SOLVAY SA FRN PERP | EUR | 1.812.605,71 | 0,11 |
| 400.000 | SOLVAY SA 1.625% 02/12/2022 | EUR | 407.102,52 | 0,02 |
| | | | **22.521.540,75** | **1,36** |
| | **Bermuda** | | | |
| 17.947.000 | BACARDI LTD 2.750% 03/07/2023 | EUR | 18.808.387,44 | 1,14 |
| | | | **18.808.387,44** | **1,14** |
| | **Österreich** | | | |
| 3.500.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.375% 16/04/2024 EMTN | EUR | 3.555.081,81 | 0,21 |
| 1.700.000 | ERSTE GROUP BANK AG 08/09/2031 FRN EMTN | EUR | 1.764.615,30 | 0,11 |
| 1.000.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.875% 13/05/2027 EMTN | EUR | 1.038.432,98 | 0,06 |
| 4.400.000 | ERSTE GROUP BANK AG 10/06/2030 FRN EMTN | EUR | 4.456.063,04 | 0,28 |
| 2.400.000 | ERSTE GROUP BANK AG 16/11/2028 FRN EMTN | EUR | 2.366.371,70 | 0,14 |
| 2.100.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.250% 22/01/2025 EMTN | EUR | 2.121.371,97 | 0,13 |
| 1.300.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.375% 25/09/2026 EMTN | EUR | 1.319.129,81 | 0,08 |
| 400.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 18/06/2032 FRN | EUR | 436.856,05 | 0,03 |
| | | | **17.057.922,66** | **1,04** |
| | **Portugal** | | | |
| 1.500.000 | BRISA CONCESSAO RODOVIARIA SA 1.875% 30/04/2025 EMTN | EUR | 1.603.003,16 | 0,10 |
| 500.000 | BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.000% 22/03/2023 EMTN | EUR | 515.999,77 | 0,03 |
| 4.900.000 | BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN | EUR | 5.475.226,19 | 0,33 |
| 1.000.000 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 1.625% 15/04/2027 EMTN | EUR | 1.071.829,33 | 0,06 |
| 2.000.000 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 30/04/2079 FRN | EUR | 2.170.793,86 | 0,13 |
| 5.300.000 | GALP ENERGIA SGPS SA 2.000% 15/01/2026 EMTN | EUR | 5.576.738,18 | 0,34 |
| | | | **16.413.590,49** | **0,99** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 1.341.000 | ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 0.200% 23/09/2027 EMTN | EUR | 1.334.515,14 | 0,08 |
| 1.900.000 | ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 1.125% 20/03/2025 EMTN | EUR | 1.978.155,09 | 0,12 |
| 4.600.000 | ASB FINANCE LTD 0.250% 08/09/2028 EMTN | EUR | 4.548.884,25 | 0,27 |
| 2.805.000 | BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.375% 14/09/2024 GMTN | EUR | 2.850.228,63 | 0,17 |
| 1.405.000 | BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.500% 13/05/2023 GMTN | EUR | 1.424.476,95 | 0,09 |
| 2.291.000 | WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.100% 13/07/2027 | EUR | 2.264.292,16 | 0,14 |
| | | | **14.400.552,22** | **0,87** |
| | **Island** | | | |
| 700.000 | ARION BANKI HF 0.625% 27/05/2024 EMTN | EUR | 708.784,29 | 0,04 |
| 955.000 | ARION BANKI HF 1.625% 01/12/2021 EMTN | EUR | 957.714,59 | 0,06 |
| 1.550.000 | ISLANDSBANKI HF 1.125% 12/04/2022 GMTN | EUR | 1.560.214,84 | 0,09 |
| 3.400.000 | ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN | EUR | 3.447.395,86 | 0,21 |
| 5.200.000 | LANDSBANKINN HF 0.500% 20/05/2024 EMTN | EUR | 5.250.067,42 | 0,32 |
| 2.000.000 | LANDSBANKINN HF 1.000% 30/05/2023 EMTN | EUR | 2.034.970,54 | 0,12 |
| | | | **13.959.147,54** | **0,84** |
| | **Australien** | | | |
| 1.000.000 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 0.625% 21/02/2023 EMTN | EUR | 1.015.141,29 | 0,06 |
| 1.981.000 | TELSTRA CORP LTD 1.000% 23/04/2030 | EUR | 2.066.073,29 | 0,12 |
| 3.000.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.750% 29/03/2028 EMTN | EUR | 3.228.004,29 | 0,20 |
| 3.100.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.875% 16/09/2024 EMTN | EUR | 3.264.245,94 | 0,20 |
| 196.000 | WESTPAC BANKING CORP 0.875% 17/04/2027 EMTN | EUR | 204.487,30 | 0,01 |
| 3.153.000 | WESTPAC BANKING CORP 13/05/2031 FRN | EUR | 3.154.436,82 | 0,19 |
| | | | **12.932.388,93** | **0,78** |
| | **Singapur** | | | |
| 10.240.000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD 11/04/2028 FRN GMTN | EUR | 10.474.445,72 | 0,63 |
| | | | **10.474.445,72** | **0,63** |
| | **Norwegen** | | | |
| 900.000 | DNB BANK ASA 01/03/2027 FRN EMTN | EUR | 904.790,67 | 0,05 |
| 4.320.000 | DNB BANK ASA 0.250% 09/04/2024 | EUR | 4.380.991,83 | 0,27 |
| 1.000.000 | DNB BANK ASA 20/03/2028 FRN | EUR | 1.016.649,27 | 0,06 |
| 4.021.000 | SPAREBANK 1 SR-BANK ASA 15/07/2027 FRN EMTN | EUR | 4.009.975,06 | 0,24 |
| | | | **10.312.406,83** | **0,62** |
| | **Ungarn** | | | |
| 2.570.000 | MOL HUNGARIAN OIL & GAS PLC 1.500% 08/10/2027 | EUR | 2.653.851,24 | 0,16 |
| 3.624.000 | MOL HUNGARIAN OIL & GAS PLC 2.625% 28/04/2023 | EUR | 3.771.509,59 | 0,23 |
| | | | **6.425.360,83** | **0,39** |
| | **Dänemark** | | | |
| 1.742.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.375% 30/06/2027 | EUR | 1.762.057,41 | 0,11 |
| 3.000.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.875% 01/07/2029 EMTN | EUR | 3.097.004,97 | 0,18 |
| 1.130.000 | JYSKE BANK AS 15/10/2025 FRN EMTN | EUR | 1.142.014,45 | 0,07 |
| | | | **6.001.076,83** | **0,36** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 3.134.000 | XLIT LTD 29/06/2047 FRN | EUR | 3.518.887,39 | 0,21 |
| | | | **3.518.887,39** | **0,21** |
| | **Mexiko** | | | |
| 3.000.000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV 06/09/2073 FRN | EUR | 3.342.370,32 | 0,20 |
| | | | **3.342.370,32** | **0,20** |
| | **Kanada** | | | |
| 2.589.000 | FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028 | EUR | 2.867.799,70 | 0,17 |
| | | | **2.867.799,70** | **0,17** |
| | **Jersey** | | | |
| 552.000 | HEATHROW FUNDING LTD 1.875% 12/07/2032 EMTN | EUR | 584.054,56 | 0,04 |
| 1.400.000 | HEATHROW FUNDING LTD 1.875% 14/03/2034 EMTN | EUR | 1.463.121,25 | 0,08 |
| | | | **2.047.175,81** | **0,12** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Tschechische Republik** | | | | |
| 1.045.000 | EP INFRASTRUCTURE AS 2.045% 09/10/2028 | EUR | 1.104.238,11 | 0,07 |
| | | | **1.104.238,11** | **0,07** |
| | | | **1.628.359.233,04** | **98,45** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| **Luxemburg** | | | | |
| 31.380 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 31.088.579,12 | 1,88 |
| | | | **31.088.579,12** | **1,88** |
| | | | **31.088.579,12** | **1,88** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **1.659.447.812,16** | **100,33** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swaps** | | | | | | |
| CDS GLENCORE INTERNATIONAL AG 5.000% 20/06/2022 | Verkauf | 5,000 | 20/06/2022 | EUR | 5.000.000,00 | 167.645,45 |
| CDS RENAULT SA 1.000% 20/12/2025 | Kauf | 1,000 | 20/12/2025 | EUR | 4.200.000,00 | 102.644,51 |
| CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026 | Verkauf | 1,000 | 20/06/2026 | EUR | 4.800.000,00 | 89.287,44 |
| CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026 | Verkauf | 1,000 | 20/06/2026 | EUR | 4.200.000,00 | 78.126,51 |
| CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026 | Verkauf | 1,000 | 20/06/2026 | EUR | 2.100.000,00 | 39.063,26 |
| CDS MICHELIN LUXEMBOURG SCS 2.7500% 20/06/2019 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2023 | EUR | 870.000,00 | 16.976,88 |
| CDS ANGLO AMERICAN PLC 5.000% 20/06/2022 | Kauf | 5,000 | 20/06/2022 | EUR | 5.000.000,00 | (174.093,65) |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | EUR | 11.000.000,00 | (1.298.457,38) |
| | | | | | | **(978.806,98)** |

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| **Zinsswaps** | | | | | |
| 0,897 | Floating | 13/10/2027 | EUR | 5.500.000,00 | 336.597,09 |
| 0.201 | Floating | 13/03/2022 | EUR | 40.000.000,00 | 132.702,80 |
| Floating | 4.190 | 19/06/2026 | EUR | 3.000.000,00 | (628.960,86) |
| | | | | | **(159.660,97)** |

| Zu erhalten | Zu zahlen | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | |
| 592.808.346,43 CZK | 23.324.866,11 EUR | 19/10/2021 | 23.324.866,11 | 47.085,19 |
| 13.456.986,10 EUR | 11.582.000,00 GBP | 31/12/2021 | 13.456.986,10 | 6.404,39 |
| 856.717,90 EUR | 1.003.000,00 USD | 31/12/2021 | 856.717,90 | (6.944,06) |
| | | | **37.638.570,11** | **46.545,52** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| (544) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 73.401.920,00 | 430.872,94 |
| (95) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 16.132.900,00 | 36.072,27 |
| 90 | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 18.300.600,00 | (639.000,00) |
| 688 | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 77.197.040,00 | (55.040,00) |
| (36) | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 5.241.689,24 | 162.925,86 |
| (16) | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 2.198.110,36 | 58.350,23 |
| | | | **192.472.259,60** | **(5.818,70)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(1.097.741,13)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **1.659.447.812,16** | **100,33** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(1.097.741,13)** | **(0,07)** |
| **Bankguthaben** | **8.237.932,84** | **0,50** |
| **Bankverbindlichkeiten** | **(5.478.660,31)** | **(0,33)** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(7.172.274,73)** | **(0,43)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **1.653.937.068,83** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) EURO Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 355.011.920,22 |
| | 30.09.2020 | EUR | 288.818.746,58 |
| | 30.09.2019 | EUR | 400.701.058,98 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 227,82 |
| | 30.09.2020 | EUR | 173,93 |
| | 30.09.2019 | EUR | 188,69 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 182.668,93 |
| | 30.09.2020 | CZK | 139.186,97 |
| | 30.09.2019 | CZK | 152.161,68 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 193,41 |
| | 30.09.2020 | EUR | 149,01 |
| | 30.09.2019 | EUR | 163,13 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 293,49 |
| | 30.09.2020 | EUR | 224,65 |
| | 30.09.2019 | EUR | 244,33 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 313,30 |
| | 30.09.2020 | EUR | 241,16 |
| | 30.09.2019 | EUR | 263,77 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 174,11 |
| | 30.09.2020 | EUR | 134,81 |
| | 30.09.2019 | EUR | 148,32 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 126,39 |
| | 30.09.2020 | EUR | 98,17 |
| | 30.09.2019 | EUR | 109,28 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 275,29 |
| | 30.09.2020 | EUR | 213,76 |
| | 30.09.2019 | EUR | 237,77 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 524.229 |
| | 30.09.2020 | | 692.162 |
| | 30.09.2019 | | 779.475 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | | 4.808 |
| | 30.09.2020 | | 4.895 |
| | 30.09.2019 | | 5.021 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 167.478 |
| | 30.09.2020 | | 203.356 |
| | 30.09.2019 | | 232.329 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 778 |
| | 30.09.2020 | | 1.402 |
| | 30.09.2019 | | 1.593 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 520.117 |
| | 30.09.2020 | 447.118 |
| | 30.09.2019 | 680.890 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 6.542 |
| | 30.09.2020 | 6.626 |
| | 30.09.2019 | 7.403 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 30.633 |
| | 30.09.2020 | 37.285 |
| | 30.09.2019 | 43.170 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1.250 |
| | 30.09.2020 | 1.293 |
| | 30.09.2019 | 1.385 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Dividende** | | | |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,85 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 3,25 |

| | | |
|---|---|---|
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 0,71% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 1,51% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,10% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 149,39% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) EURO Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **354.521.931,41** |
| Aktien | | 354.521.931,41 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **69.777,16** |
| Devisentermingeschäfte | | 69.777,16 |
| **Bankguthaben** | | **1.035.124,26** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **24.700.918,10** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***380.327.750,93*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(25.315.830,71)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(25.315.830,71)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***355.011.920,22*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **9.949.472,41** |
| Dividenden | | 9.844.700,20 |
| Sonstige Erträge | 10 | 104.772,21 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(3.998.352,70)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (3.224.487,74) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (702.313,78) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (6.631,17) |
| Abonnementsteuer | 9 | (50.464,27) |
| Bankzinsen | | (14.455,74) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **5.951.119,71** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 47.319.934,28 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (11.744.788,54) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 1.196.959,27 |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 10.660,20 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (10.313,20) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 47.400.267,30 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 886.459,98 |
| **Ergebnis** | | **91.010.299,00** |
| Zeichnungen | | 105.127.126,89 |
| Rücknahmen | | (129.909.585,65) |
| Ausschüttung | | (34.666,60) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 288.818.746,58 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***355.011.920,22*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) EURO Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Frankreich** | | | | |
| 21.817 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 3.023.399,86 | 0,85 |
| 107.319 | AMUNDI SA | EUR | 7.823.555,10 | 2,20 |
| 160.393 | BNP PARIBAS SA | EUR | 8.892.187,92 | 2,50 |
| 153.838 | BOUYGUES SA | EUR | 5.522.784,20 | 1,56 |
| 3.602 | CAPGEMINI SE | EUR | 648.900,30 | 0,18 |
| 176.009 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 10.250.764,16 | 2,89 |
| 380.049 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 4.540.065,35 | 1,28 |
| 234.134 | ENGIE SA | EUR | 2.655.547,83 | 0,75 |
| 13.598 | KERING SA | EUR | 8.376.368,00 | 2,36 |
| 24.656 | L'OREAL SA | EUR | 8.798.493,60 | 2,48 |
| 35.722 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 22.151.212,20 | 6,24 |
| 368.600 | REXEL SA | EUR | 6.179.579,00 | 1,74 |
| 167.354 | SANOFI | EUR | 13.903.770,32 | 3,92 |
| 4.114 | TELEPERFORMANCE | EUR | 1.399.171,40 | 0,39 |
| 33.174 | TOTALENERGIES SE | EUR | 1.371.247,29 | 0,39 |
| 329.219 | VIVENDI SE | EUR | 3.590.133,20 | 1,01 |
| | | | **109.127.179,73** | **30,74** |
| **Deutschland** | | | | |
| 23.687 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 4.615.175,08 | 1,30 |
| 138.311 | COVESTRO AG | EUR | 8.207.374,74 | 2,31 |
| 159.962 | DAIMLER AG - REG | EUR | 12.272.284,64 | 3,46 |
| 214.938 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 11.709.822,24 | 3,30 |
| 697.673 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 12.136.719,51 | 3,42 |
| 880.867 | E.ON SE | EUR | 9.309.002,46 | 2,61 |
| 21.590 | LEG IMMOBILIEN SE | EUR | 2.638.298,00 | 0,74 |
| 21.329 | MERCK KGAA | EUR | 4.002.386,85 | 1,13 |
| 11.275 | RWE AG | EUR | 344.451,25 | 0,10 |
| 136.737 | SAP SE | EUR | 15.981.820,56 | 4,50 |
| 110.507 | SIEMENS AG - REG | EUR | 15.683.153,44 | 4,42 |
| 68.099 | SIEMENS HEALTHINEERS AG | EUR | 3.825.801,82 | 1,08 |
| 28.934 | VOLKSWAGEN AG - PREF | EUR | 5.602.779,76 | 1,58 |
| | | | **106.329.070,35** | **29,95** |
| **Niederlande** | | | | |
| 1.085.335 | AEGON NV | EUR | 4.848.191,45 | 1,37 |
| 49.201 | ASML HOLDING NV | EUR | 31.778.925,90 | 8,95 |
| 35.178 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 1.390.234,56 | 0,39 |
| 38.021 | HEINEKEN NV | EUR | 3.429.494,20 | 0,97 |
| 286.387 | ING GROEP NV | EUR | 3.599.311,82 | 1,01 |
| 368.593 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 10.591.519,86 | 2,98 |
| 30.781 | PROSUS NV | EUR | 2.123.581,19 | 0,60 |
| 338.586 | STELLANTIS NV | EUR | 5.612.401,54 | 1,58 |
| | | | **63.373.660,52** | **17,85** |
| **Italien** | | | | |
| 810.258 | ENI SPA | EUR | 9.355.238,87 | 2,64 |
| 4.542.359 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 11.144.677,81 | 3,13 |
| 206.990 | UNICREDIT SPA | EUR | 2.380.385,00 | 0,67 |
| | | | **22.880.301,68** | **6,44** |
| **Spanien** | | | | |
| 349.807 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | EUR | 1.999.846,62 | 0,56 |
| 1.373.972 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 4.309.463,18 | 1,22 |
| 592.872 | IBERDROLA SA | EUR | 5.148.500,45 | 1,45 |
| 145.110 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 4.617.400,20 | 1,30 |
| 57.975 | REPSOL SA | EUR | 655.001,55 | 0,18 |
| | | | **16.730.212,00** | **4,71** |
| **Luxemburg** | | | | |
| 72.779 | APERAM SA | EUR | 3.484.658,52 | 0,98 |
| 260.274 | ARCELORMITTAL SA | EUR | 6.886.850,04 | 1,94 |
| 89.587 | TENARIS SA | EUR | 814.525,00 | 0,23 |
| | | | **11.186.033,56** | **3,15** |
| **Österreich** | | | | |
| 66.622 | ERSTE GROUP BANK AG | EUR | 2.535.633,32 | 0,71 |
| 127.868 | OMV AG | EUR | 6.672.152,24 | 1,89 |
| 39.106 | WIENERBERGER AG | EUR | 1.139.548,84 | 0,32 |
| | | | **10.347.334,40** | **2,92** |
| **Irland** | | | | |
| 68.617 | CRH PLC | EUR | 2.783.105,52 | 0,78 |
| 146.696 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 6.657.064,48 | 1,88 |
| | | | **9.440.170,00** | **2,66** |
| **Finnland** | | | | |
| 30.282 | KESKO OYJ - B | EUR | 903.614,88 | 0,25 |
| 81.253 | UPM-KYMMENE OYJ | EUR | 2.495.279,63 | 0,71 |
| | | | **3.398.894,51** | **0,96** |
| **Belgien** | | | | |
| 39.913 | AGEAS SA/NV | EUR | 1.709.074,66 | 0,48 |
| | | | **1.709.074,66** | **0,48** |
| | | | **354.521.931,41** | **99,86** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **354.521.931,41** | **99,86** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 885.782.733,16 | CZK | 34.852.349,42 | EUR | 19/10/2021 | 34.852.349,42 | 70.355,41 |
| 117.694,44 | EUR | 2.999.879,45 | CZK | 19/10/2021 | 117.694,44 | (578,25) |
| | | | | | **34.970.043,86** | **69.777,16** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **69.777,16** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) EURO Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **354.521.931,41** | **99,86** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **69.777,16** | **0,02** |
| **Bankguthaben** | **1.035.124,26** | **0,29** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(614.912,61)** | **(0,17)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **355.011.920,22** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 1.243.629.109,61 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.212.390.936,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.260.604.625,33 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 623,78 |
| | 30.09.2020 | EUR | 630,50 |
| | 30.09.2019 | EUR | 632,64 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 594,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | 601,49 |
| | 30.09.2019 | EUR | 603,87 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 598,02 |
| | 30.09.2020 | EUR | 603,89 |
| | 30.09.2019 | EUR | 605,37 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 580,68 |
| | 30.09.2020 | EUR | 589,04 |
| | 30.09.2019 | EUR | 593,14 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 161,07 |
| | 30.09.2020 | EUR | 163,28 |
| | 30.09.2019 | EUR | 164,30 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 570,14 |
| | 30.09.2020 | EUR | 578,92 |
| | 30.09.2019 | EUR | 583,53 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.262,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.314,63 |
| | 30.09.2019 | EUR | 7.313,12 |
| Distribution O (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.301,01 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.313,78 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.318,22 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.282,40 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.300,83 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.309,90 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 32,73 |
| | 30.09.2020 | EUR | 33,10 |
| | 30.09.2019 | EUR | 33,24 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 1.122.162 |
| | 30.09.2020 | | 1.049.409 |
| | 30.09.2019 | | 1.185.704 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 8.334 |
| | 30.09.2020 | | 9.114 |
| | 30.09.2019 | | 10.380 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 2.452 |
| | 30.09.2020 | 2.489 |
| | 30.09.2019 | 2.683 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 119.430 |
| | 30.09.2020 | 107.663 |
| | 30.09.2019 | 107.238 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 1.533.085 |
| | 30.09.2020 | 1.553.084 |
| | 30.09.2019 | 1.375.738 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 21.253 |
| | 30.09.2020 | 22.496 |
| | 30.09.2019 | 27.688 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 25.006 |
| | 30.09.2020 | 24.708 |
| | 30.09.2019 | 21.739 |
| Distribution O (EUR) | 30.09.2021 | 1.279 |
| | 30.09.2020 | 1.659 |
| | 30.09.2019 | 1.801 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 14.256 |
| | 30.09.2020 | 17.345 |
| | 30.09.2019 | 19.260 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 222.163 |
| | 30.09.2020 | 249.521 |
| | 30.09.2019 | 306.981 |
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,55% |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 0,40% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,85% |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 0,78% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,13% |
| Distribution O (EUR) | 30.09.2021 | 0,40% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 0,85% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 10,63% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **1.186.766.834,88** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 121.213.640,97 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 1.065.553.193,91 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **9.024.146,07** |
| Credit Default Swaps | | 4.506.927,72 |
| Zinsswaps | | 3.249.351,47 |
| Total Return Swaps | | 810.811,86 |
| Futures | | 457.055,02 |
| **Bankguthaben** | | **42.620.944,76** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **9.754.107,41** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **48.489.778,83** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***1.296.655.811,95*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(53.026.702,34)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(53.026.702,34)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.243.629.109,61*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **15.838.872,60** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 9.423.232,69 |
| Zinsen auf Swaps | | 6.411.826,33 |
| Sonstige Erträge | 10 | 3.813,58 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(7.008.459,74)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (4.832.513,56) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.529.627,09) |
| Abonnementsteuer | 9 | (156.376,45) |
| Bankzinsen | | (489.942,64) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **8.830.412,86** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 76.721.124,34 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (102.744,23) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 75.752.732,27 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (150.671.291,49) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 9.794,51 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (33.127.509,78) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 8.592.235,69 |
| **Ergebnis** | | **(13.995.245,83)** |
| Zeichnungen | | 225.536.130,03 |
| Rücknahmen | | (180.302.711,01) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 1.212.390.936,42 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.243.629.109,61*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Frankreich** | | | |
| 300.000 | AGENCE FRANCAISE DE DEVELOPPEMENT EPIC 3.125% 04/01/2024 EMTN | EUR | 324.379,67 | 0,03 |
| 200.000 | AGENCE FRANCE LOCALE 0.375% 20/03/2022 EMTN | EUR | 200.745,56 | 0,02 |
| 500.000 | APRR SA 1.250% 06/01/2027 EMTN | EUR | 533.203,70 | 0,04 |
| 600.000 | AXA BANK EUROPE SCF 0.750% 06/03/2029 EMTN | EUR | 633.097,90 | 0,05 |
| 1.300.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.010% 11/05/2026 EMTN | EUR | 1.296.433,06 | 0,10 |
| 300.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 19/07/2028 | EUR | 294.648,63 | 0,02 |
| 500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 29/06/2028 EMTN | EUR | 498.748,26 | 0,04 |
| 500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.625% 03/11/2028 EMTN | EUR | 503.060,89 | 0,04 |
| 300.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN | EUR | 309.440,11 | 0,02 |
| 1.500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 17/07/2025 EMTN | EUR | 1.545.612,80 | 0,12 |
| 100.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 24/03/2026 EMTN | EUR | 108.976,21 | 0,01 |
| 500.000 | BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN | EUR | 507.407,83 | 0,04 |
| 600.000 | BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN | EUR | 597.561,71 | 0,05 |
| 1.100.000 | BNP PARIBAS SA 15/01/2032 FRN EMTN | EUR | 1.115.965,38 | 0,09 |
| 600.000 | BNP PARIBAS SA 19/02/2028 FRN EMTN | EUR | 601.105,82 | 0,05 |
| 900.000 | BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN | EUR | 969.832,31 | 0,08 |
| 978.133 | BPCE HOME LOANS FCT 2018 2018-1 A 31/10/2053 FRN | EUR | 983.052,40 | 0,08 |
| 888.330 | BPCE HOME LOANS FCT 2020 2020-1 A 31/10/2054 FRN | EUR | 900.385,00 | 0,07 |
| 200.000 | BPCE SA 0.125% 04/12/2024 | EUR | 202.030,77 | 0,02 |
| 500.000 | BPCE SA 0.250% 14/01/2031 | EUR | 484.935,34 | 0,04 |
| 200.000 | BPCE SA 0.375% 05/10/2023 EMTN | EUR | 202.925,20 | 0,02 |
| 1.600.000 | BPCE SA 0.625% 15/01/2030 | EUR | 1.619.535,04 | 0,13 |
| 500.000 | BPCE SFH SA 0.010% 08/11/2026 EMTN | EUR | 505.012,35 | 0,04 |
| 500.000 | BPCE SFH SA 0.625% 29/05/2031 | EUR | 522.077,11 | 0,04 |
| 1.500.000 | BPCE SFH SA 1.750% 27/06/2024 EMTN | EUR | 1.587.944,18 | 0,13 |
| 300.000 | BPIFRANCE SACA 0.500% 25/05/2025 EMTN | EUR | 309.509,72 | 0,02 |
| 3.500.000 | CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE ZCP 25/11/2030 | EUR | 3.449.013,37 | 0,28 |
| 3.400.000 | CAISSE D'AMORTISSEMENT DE LA DETTE SOCIALE 4.125% 25/04/2023 EMTN | EUR | 3.648.393,90 | 0,29 |
| 700.000 | CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 0.010% 08/10/2029 | EUR | 698.500,85 | 0,06 |
| 1.000.000 | CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 0.010% 27/11/2026 | EUR | 1.010.053,56 | 0,08 |
| 1.500.000 | CAISSE DE REFINANCEMENT DE L'HABITAT SA 3.600% 08/03/2024 EMTN | EUR | 1.647.143,31 | 0,13 |
| 600.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.250% 11/05/2032 EMTN | EUR | 664.983,13 | 0,05 |
| 400.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.500% 28/06/2038 | EUR | 467.059,54 | 0,04 |
| 1.500.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 5.375% 08/07/2024 EMTN | EUR | 1.739.656,77 | 0,14 |
| 300.000 | CAPGEMINI SE 1.000% 18/10/2024 | EUR | 309.662,83 | 0,02 |
| 1.500.000 | CAPGEMINI SE 2.500% 01/07/2023 | EUR | 1.562.501,73 | 0,13 |
| 1.500.000 | CCR RE SA 15/07/2040 FRN | EUR | 1.642.705,28 | 0,13 |
| 600.000 | CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 0.200% 16/09/2022 EMTN | EUR | 604.061,65 | 0,05 |
| 800.000 | CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 0.375% 11/12/2024 | EUR | 818.444,23 | 0,07 |
| 1.000.000 | CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 0.875% 11/09/2028 | EUR | 1.064.090,20 | 0,09 |
| 300.000 | CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 2.000% 07/05/2024 EMTN | EUR | 318.755,47 | 0,03 |
| 100.000 | CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 3.875% 25/04/2055 EMTN | EUR | 185.606,94 | 0,01 |
| 700.000 | CIE DE SAINT-GOBAIN 2.375% 04/10/2027 | EUR | 790.922,85 | 0,06 |
| 200.000 | COVIVIO 1.625% 23/06/2030 | EUR | 216.568,81 | 0,02 |
| 100.000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA 27/09/2048 FRN | EUR | 122.599,14 | 0,01 |
| 400.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.500% 03/04/2025 EMTN | EUR | 411.572,32 | 0,03 |
| 1.000.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.500% 19/02/2026 EMTN | EUR | 1.033.109,94 | 0,08 |
| 1.200.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.875% 11/08/2028 EMTN | EUR | 1.276.973,42 | 0,10 |
| 700.000 | CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 21/10/2025 EMTN | EUR | 709.102,97 | 0,06 |
| 800.000 | CREDIT AGRICOLE SA 2.000% 25/03/2029 EMTN | EUR | 865.000,57 | 0,07 |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE SA 21/09/2029 FRN EMTN | EUR | 198.629,10 | 0,02 |
| 600.000 | CREDIT AGRICOLE SA 22/04/2026 FRN EMTN | EUR | 618.609,89 | 0,05 |
| 400.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 0.750% 05/12/2023 EMTN | EUR | 409.709,19 | 0,03 |
| 300.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.250% 14/04/2026 EMTN | EUR | 317.343,46 | 0,03 |
| 900.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 03/05/2027 EMTN | EUR | 962.003,96 | 0,08 |
| 1.100.000 | CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 0.625% 02/02/2026 EMTN | EUR | 1.142.167,98 | 0,09 |
| 500.000 | CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 1.000% 30/01/2029 EMTN | EUR | 537.139,03 | 0,04 |
| 300.000 | CREDIT MUTUEL - HOME LOAN SFH SA 2.500% 11/09/2023 EMTN | EUR | 317.279,25 | 0,03 |
| 200.000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.875% 07/05/2027 EMTN | EUR | 207.182,97 | 0,02 |
| 100.000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 25/10/2029 FRN EMTN | EUR | 104.388,73 | 0,01 |
| 800.000 | DANONE SA 0.709% 03/11/2024 EMTN | EUR | 822.078,97 | 0,07 |
| 1.600.000 | ESSILORLUXOTTICA SA 0.125% 27/05/2025 EMTN | EUR | 1.618.256,99 | 0,13 |
| 200.000 | EUTELSAT SA 1.500% 13/10/2028 | EUR | 203.799,21 | 0,02 |
| 410.244 | FCT CREDIT AGRICOLE HABITAT 2017 2017-1 A 27/06/2052 FRN | EUR | 410.946,49 | 0,03 |
| 1.300.000 | FCT CREDIT AGRICOLE HABITAT 2020 2020-1 A 27/07/2055 FRN | EUR | 1.323.562,31 | 0,11 |
| 21.780 | FCT TITRISOCRAM 2017 2017-1 A 25/07/2036 FRN | EUR | 21.791,96 | 0,00 |
| 3.580.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/11/2029 | EUR | 3.595.576,51 | 0,29 |
| 3.520.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.250% 25/11/2026 | EUR | 3.637.856,78 | 0,29 |
| 4.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2025 | EUR | 4.153.612,84 | 0,33 |
| 4.140.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.750% 25/05/2028 | EUR | 4.411.769,60 | 0,35 |
| 4.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.750% 25/11/2028 | EUR | 4.266.728,20 | 0,34 |
| 7.230.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.000% 25/05/2027 | EUR | 7.781.125,98 | 0,63 |
| 18.283.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.000% 25/11/2025 | EUR | 19.432.563,92 | 1,56 |
| 1.365.367 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.500% 25/05/2031 | EUR | 1.551.732,50 | 0,12 |
| 2.240.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/05/2023 | EUR | 2.329.886,72 | 0,19 |
| 14.286.448 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/05/2066 | EUR | 17.951.070,35 | 1,44 |
| 10.980.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/11/2024 | EUR | 11.796.112,33 | 0,95 |
| 50.104.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.000% 25/05/2048 | EUR | 64.344.934,66 | 5,17 |
| 4.900.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.000% 25/04/2022 | EUR | 5.001.650,60 | 0,40 |
| 3.700.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.500% 25/04/2026 | EUR | 4.374.370,44 | 0,35 |
| 9.140.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/10/2038 | EUR | 14.412.671,32 | 1,16 |
| 1.300.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.250% 25/10/2023 | EUR | 1.433.064,72 | 0,12 |
| 1.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.500% 25/04/2041 | EUR | 1.723.063,76 | 0,14 |
| 5.850.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.750% 25/04/2035 | EUR | 9.302.042,12 | 0,75 |
| 6.679.061 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 5.750% 25/10/2032 | EUR | 10.788.679,69 | 0,87 |
| 1.050.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 6.000% 25/10/2025 | EUR | 1.331.813,26 | 0,11 |
| 1.253.006 | HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 2019-1 A 27/11/2024 FRN | EUR | 1.267.360,74 | 0,10 |
| 600.932 | HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 2020-2 2020-2 A 27/10/2020 FRN | EUR | 608.459,93 | 0,05 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.900.000 | HARMONY FRENCH HOME LOANS FCT 2021-1 2021-1 A 27/05/2061 FRN | EUR | 1.925.689,29 | 0,15 |
| 500.000 | HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.100% 03/09/2027 EMTN | EUR | 496.187,47 | 0,04 |
| 400.000 | HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.250% 17/05/2024 EMTN | EUR | 405.290,43 | 0,03 |
| 200.000 | ICADE SANTE SAS 1.375% 17/09/2030 | EUR | 209.584,32 | 0,02 |
| 400.000 | IMERYS SA 1.500% 15/01/2027 EMTN | EUR | 422.476,23 | 0,03 |
| 2.000.000 | KERING SA 1.250% 10/05/2026 EMTN | EUR | 2.118.717,30 | 0,17 |
| 800.000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.375% 11/02/2031 | EUR | 809.223,22 | 0,07 |
| 600.000 | ORANGE SA FRN PERP EMTN | EUR | 630.122,76 | 0,05 |
| 1.000.000 | ORANGE SA 1.375% 16/01/2030 EMTN | EUR | 1.083.979,79 | 0,09 |
| 400.000 | ORANGE SA 1.625% 07/04/2032 EMTN | EUR | 442.805,30 | 0,04 |
| 400.000 | PERNOD RICARD SA 0.500% 24/10/2027 | EUR | 409.652,67 | 0,03 |
| 406.000 | RCI BANQUE SA 1.375% 08/03/2024 EMTN | EUR | 418.365,92 | 0,03 |
| 500.000 | REGION OF ILE DE FRANCE 0.500% 14/06/2025 EMTN | EUR | 514.814,86 | 0,04 |
| 500.000 | RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 1.000% 19/10/2026 EMTN | EUR | 522.239,78 | 0,04 |
| 300.000 | RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 1.875% 23/10/2037 EMTN | EUR | 341.219,29 | 0,03 |
| 300.000 | SANEF SA 1.875% 16/03/2026 | EUR | 321.000,41 | 0,03 |
| 403.165 | SAPPHIREONE MORTGAGES FCT 2016-3 2016-3 A 27/06/2061 FRN | EUR | 403.528,33 | 0,03 |
| 300.000 | SOCIETE GENERALE SA 0.875% 01/07/2026 EMTN | EUR | 307.305,32 | 0,02 |
| 400.000 | SOCIETE GENERALE SA 1.250% 12/06/2030 | EUR | 411.898,73 | 0,03 |
| 800.000 | SOCIETE GENERALE SFH SA 0.250% 11/09/2023 EMTN | EUR | 810.952,70 | 0,07 |
| 500.000 | SOCIETE GENERALE SFH SA 0.500% 02/06/2025 EMTN | EUR | 515.016,53 | 0,04 |
| 1.100.000 | SOCIETE GENERALE SFH SA 0.500% 30/01/2025 | EUR | 1.130.792,62 | 0,09 |
| 1.000.000 | TEREGA SA 0.875% 17/09/2030 | EUR | 1.006.732,77 | 0,08 |
| 400.000 | TEREGA SASU 0.625% 27/02/2028 | EUR | 398.018,42 | 0,03 |
| 620.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 634.802,48 | 0,05 |
| 795.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 812.471,40 | 0,07 |
| 978.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 1.030.769,99 | 0,08 |
| 1.200.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 1.326.000,00 | 0,11 |
| 300.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 0.875% 29/03/2032 EMTN | EUR | 295.594,72 | 0,02 |
| 100.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.375% 04/12/2031 EMTN | EUR | 103.768,99 | 0,01 |
| 100.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.750% 01/07/2049 EMTN | EUR | 96.995,16 | 0,01 |
| 195.000 | WPP FINANCE SA 2.375% 19/05/2027 EMTN | EUR | 217.830,47 | 0,02 |
| | | | **267.898.993,86** | **21,54** |
| | **Deutschland** | | | |
| 200.000 | ADIDAS AG 0.625% 10/09/2035 | EUR | 198.807,21 | 0,02 |
| 200.000 | ALBEMARLE NEW HOLDING GMBH 1.625% 25/11/2028 | EUR | 214.070,55 | 0,02 |
| 200.000 | ALSTRIA OFFICE REIT-AG 1.500% 15/11/2027 | EUR | 208.094,27 | 0,02 |
| 1.000.000 | BAYER AG 0.750% 06/01/2027 | EUR | 1.019.908,01 | 0,08 |
| 500.000 | BAYERISCHE LANDESBODENKREDITANSTALT 1.875% 25/01/2023 | EUR | 515.530,38 | 0,04 |
| 38.146.529 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/02/2027 | EUR | 39.805.664,21 | 3,21 |
| 3.240.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/02/2029 | EUR | 3.399.123,92 | 0,27 |
| 5.400.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2026 | EUR | 5.668.939,55 | 0,47 |
| 2.790.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2028 | EUR | 2.965.846,56 | 0,24 |
| 4.040.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/08/2027 | EUR | 4.283.315,38 | 0,34 |
| 5.841.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.000% 04/01/2037 | EUR | 9.453.833,73 | 0,77 |
| 4.528.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.750% 04/07/2034 | EUR | 7.397.199,39 | 0,60 |
| 450.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 5.500% 04/01/2031 | EUR | 697.624,79 | 0,06 |
| 38.300.000 | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN ZCP 10/06/2022 | EUR | 38.475.959,39 | 3,10 |
| 1.000.000 | COMMERZBANK AG 0.125% 09/01/2024 EMTN | EUR | 1.012.813,27 | 0,08 |
| 450.000 | COMMERZBANK AG 0.500% 09/06/2026 EMTN | EUR | 465.676,79 | 0,04 |
| 400.000 | COMMERZBANK AG 0.875% 22/01/2027 EMTN | EUR | 405.968,80 | 0,03 |
| 500.000 | COMMERZBANK AG 1.000% 04/03/2026 EMTN | EUR | 519.064,97 | 0,04 |
| 208.000 | COMMERZBANK AG 1.500% 28/08/2028 EMTN | EUR | 223.864,77 | 0,02 |
| 308.000 | CONTINENTAL AG ZCP 12/09/2023 | EUR | 308.876,28 | 0,02 |
| 508.000 | COVESTRO AG 0.875% 03/02/2026 EMTN | EUR | 524.073,46 | 0,04 |
| 508.000 | COVESTRO AG 1.375% 12/06/2030 EMTN | EUR | 542.168,70 | 0,04 |
| 800.000 | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH FRN PERP | EUR | 819.000,00 | 0,07 |
| 400.000 | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 2.500% 12/09/2023 EMTN | EUR | 422.053,84 | 0,03 |
| 400.000 | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH 3.000% 08/03/2024 EMTN | EUR | 432.725,00 | 0,03 |
| 222.000 | DEUTSCHE BANK AG 10/06/2026 FRN EMTN | EUR | 232.773,28 | 0,02 |
| 200.000 | DEUTSCHE BANK AG 1.625% 20/01/2027 EMTN | EUR | 210.634,47 | 0,02 |
| 300.000 | DEUTSCHE BANK AG 17/02/2032 FRN | EUR | 303.972,51 | 0,02 |
| 100.000 | DEUTSCHE BANK AG 19/11/2030 FRN EMTN | EUR | 105.333,90 | 0,01 |
| 500.000 | DEUTSCHE TELEKOM AG 1.750% 25/03/2031 EMTN | EUR | 560.648,69 | 0,05 |
| 1.400.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 31/08/2081 FRN | EUR | 1.383.497,86 | 0,11 |
| 700.000 | EUROGRID GMBH 1.500% 18/04/2028 EMTN | EUR | 754.213,98 | 0,06 |
| 2.000.000 | EUROGRID GMBH 1.625% 03/11/2023 EMTN | EUR | 2.069.513,32 | 0,17 |
| 500.000 | HANNOVER RUECK SE 08/10/2040 FRN | EUR | 522.396,39 | 0,04 |
| 500.000 | LAND BADEN-WUERTTEMBERG 0.625% 09/02/2027 | EUR | 522.890,15 | 0,04 |
| 165.000 | LANXESS AG 1.000% 07/10/2026 EMTN | EUR | 172.683,45 | 0,01 |
| 1.500.000 | MERCK KGAA 09/09/2080 FRN | EUR | 1.543.268,75 | 0,12 |
| 1.000.000 | MERCK KGAA 12/12/2074 FRN | EUR | 1.091.304,46 | 0,09 |
| 100.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2049 FRN | EUR | 115.391,06 | 0,01 |
| 44.591 | RED & BLACK AUTO GERMANY 5 UG HAFTUNGSBESCHRANKT -5 A 15/01/2027 FRN | EUR | 44.645,28 | 0,00 |
| 500.000 | SANTANDER CONSUMER BANK AG 0.750% 17/10/2022 EMTN | EUR | 505.555,10 | 0,04 |
| 250.000 | STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 1.875% 15/03/2024 EMTN | EUR | 264.474,08 | 0,02 |
| 250.000 | STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 4.375% 29/04/2022 | EUR | 257.099,11 | 0,02 |
| 955.000 | SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025 | EUR | 998.845,87 | 0,08 |
| 238.000 | SYMRISE AG 1.375% 01/07/2027 | EUR | 251.061,77 | 0,02 |
| 430.000 | UNICREDIT BANK AG 0.250% 15/01/2032 | EUR | 433.295,56 | 0,03 |
| 985.000 | UNICREDIT BANK AG 0.625% 20/11/2025 EMTN | EUR | 1.022.129,85 | 0,08 |
| 600.000 | VANTAGE TOWERS AG 0.375% 31/03/2027 EMTN | EUR | 599.758,83 | 0,05 |
| 300.000 | VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.250% 01/08/2022 EMTN | EUR | 303.892,02 | 0,02 |
| 1.600.000 | VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.250% 10/06/2024 EMTN | EUR | 1.652.997,34 | 0,13 |
| 1.000.000 | VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.875% 31/01/2024 EMTN | EUR | 1.043.981,88 | 0,08 |
| 200.000 | VOLKSWAGEN BANK GMBH 2.500% 31/07/2026 EMTN | EUR | 221.014,28 | 0,02 |
| 284.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.125% 12/02/2027 EMTN | EUR | 280.012,72 | 0,02 |
| 404.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.625% 01/04/2022 EMTN | EUR | 405.995,78 | 0,03 |
| 1.000.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.500% 01/10/2024 EMTN | EUR | 1.043.713,66 | 0,08 |
| 101.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.250% 16/10/2026 EMTN | EUR | 110.990,15 | 0,01 |
| 110.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 3.375% 06/04/2028 EMTN | EUR | 129.503,28 | 0,01 |
| 150.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH ZCP 19/07/2024 EMTN | EUR | 149.979,68 | 0,01 |
| 950.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.500% 20/06/2022 EMTN | EUR | 955.729,06 | 0,08 |
| 763.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.625% 19/07/2029 EMTN | EUR | 758.938,99 | 0,06 |
| 667.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.000% 16/02/2023 EMTN | EUR | 677.770,60 | 0,05 |
| 700.000 | VONOVIA SE 0.250% 01/09/2028 EMTN | EUR | 687.569,83 | 0,06 |
| 300.000 | VONOVIA SE 0.625% 14/12/2029 EMTN | EUR | 299.898,12 | 0,02 |
| 900.000 | VONOVIA SE 0.750% 01/09/2032 EMTN | EUR | 877.299,93 | 0,07 |
| | | | **143.544.878,26** | **11,54** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Italien** | | | |
| 500.000 | CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 0.625% 13/01/2026 EMTN | EUR | 517.932,03 | 0,04 |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 1.000% 30/09/2031 EMTN | EUR | 215.784,55 | 0,02 |
| 1.200.000 | ENEL SPA 24/05/2080 FRN | EUR | 1.306.193,20 | 0,11 |
| 600.000 | ENI SPA 1.000% 14/03/2025 EMTN | EUR | 621.380,72 | 0,05 |
| 523.000 | FCA BANK SPA/IRELAND ZCP 16/04/2024 EMTN | EUR | 523.390,90 | 0,04 |
| 138.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.125% 16/11/2023 EMTN | EUR | 138.554,29 | 0,01 |
| 759.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.250% 28/02/2023 EMTN | EUR | 763.260,62 | 0,06 |
| 210.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.625% 24/11/2022 EMTN | EUR | 211.911,65 | 0,02 |
| 375.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 04/12/2024 EMTN | EUR | 384.280,18 | 0,03 |
| 250.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN | EUR | 253.099,43 | 0,02 |
| 400.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.000% 19/11/2026 EMTN | EUR | 412.599,42 | 0,03 |
| 400.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.125% 14/07/2025 EMTN | EUR | 421.988,89 | 0,03 |
| 300.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.375% 18/01/2024 EMTN | EUR | 310.560,23 | 0,02 |
| 885.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.750% 04/07/2029 EMTN | EUR | 952.676,30 | 0,08 |
| 300.000 | INTESA SANPAOLO SPA 3.625% 05/12/2022 EMTN | EUR | 314.507,21 | 0,03 |
| 4.130.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.950% 15/09/2027 | EUR | 4.284.755,56 | 0,34 |
| 12.605.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.250% 01/12/2026 | EUR | 13.306.048,76 | 1,08 |
| 500.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.350% 15/04/2022 | EUR | 505.011,32 | 0,04 |
| 4.972.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.450% 15/09/2022 | EUR | 5.062.563,54 | 0,41 |
| 7.414.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.650% 01/03/2032 | EUR | 7.955.776,57 | 0,64 |
| 3.570.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.800% 01/03/2041 | EUR | 3.726.395,35 | 0,30 |
| 3.750.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.000% 01/02/2028 | EUR | 4.133.811,23 | 0,33 |
| 9.630.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.000% 01/12/2025 | EUR | 10.437.559,57 | 0,84 |
| 4.160.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.200% 01/06/2027 | EUR | 4.617.090,15 | 0,37 |
| 4.201.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.500% 01/12/2024 | EUR | 4.556.920,36 | 0,37 |
| 2.380.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.700% 01/03/2047 | EUR | 2.859.975,10 | 0,23 |
| 3.240.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.800% 01/12/2028 | EUR | 3.766.811,04 | 0,30 |
| 3.180.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.850% 01/09/2049 | EUR | 4.640.797,43 | 0,37 |
| 5.042.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.500% 01/03/2024 | EUR | 5.625.969,13 | 0,45 |
| 12.142.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.750% 01/08/2023 | EUR | 13.297.028,15 | 1,07 |
| 7.570.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.750% 01/09/2044 | EUR | 12.085.765,79 | 0,97 |
| 11.006.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.000% 01/08/2034 | EUR | 16.106.633,08 | 1,30 |
| 6.383.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.750% 01/02/2033 | EUR | 9.653.040,45 | 0,78 |
| 400.000 | MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.125% 12/08/2024 EMTN | EUR | 417.201,69 | 0,03 |
| 560.000 | TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE 0.375% 25/09/2030 EMTN | EUR | 550.415,10 | 0,04 |
| 356.000 | UNICREDIT SPA 05/07/2029 FRN EMTN | EUR | 360.135,05 | 0,03 |
| 600.000 | UNICREDIT SPA 0.850% 19/01/2031 EMTN | EUR | 591.580,19 | 0,05 |
| 292.000 | UNICREDIT SPA 25/06/2025 FRN EMTN | EUR | 300.935,19 | 0,02 |
| | | | **136.190.339,42** | **10,95** |
| | **Spanien** | | | |
| 1.400.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 3.000% 27/03/2031 EMTN | EUR | 1.633.229,78 | 0,13 |
| 500.000 | AUTONOMOUS COMMUNITY OF MADRID SPAIN 2.146% 30/04/2027 | EUR | 560.771,95 | 0,05 |
| 800.000 | AYT CEDULAS CAJAS X FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS 3.750% 30/06/2025 | EUR | 915.917,13 | 0,07 |
| 100.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 04/06/2025 FRN GMTN | EUR | 102.912,04 | 0,01 |
| 200.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 16/01/2030 FRN GMTN | EUR | 202.331,98 | 0,02 |
| 300.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 24/03/2027 FRN GMTN | EUR | 299.450,42 | 0,02 |
| 600.000 | BANCO DE SABADELL SA 1.625% 07/03/2024 EMTN | EUR | 623.539,09 | 0,05 |
| 400.000 | BANCO SANTANDER SA 0.200% 11/02/2028 EMTN | EUR | 396.741,75 | 0,03 |
| 400.000 | BANCO SANTANDER SA 0.250% 19/06/2024 EMTN | EUR | 404.558,16 | 0,03 |
| 400.000 | BANCO SANTANDER SA 0.875% 09/05/2031 EMTN | EUR | 427.268,51 | 0,03 |
| 600.000 | BANKINTER SA 0.875% 03/08/2022 | EUR | 606.617,74 | 0,05 |
| 700.000 | CAIXABANK SA 0.375% 03/02/2025 EMTN | EUR | 709.188,99 | 0,06 |
| 200.000 | CAIXABANK SA 0.750% 09/07/2026 | EUR | 205.345,12 | 0,02 |
| 300.000 | CAIXABANK SA 0.750% 18/04/2023 EMTN | EUR | 304.767,45 | 0,02 |
| 300.000 | CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN | EUR | 296.174,12 | 0,02 |
| 300.000 | CAIXABANK SA 10/07/2026 FRN EMTN | EUR | 306.922,14 | 0,02 |
| 700.000 | CAIXABANK SA 1.125% 17/05/2024 EMTN | EUR | 723.016,81 | 0,06 |
| 400.000 | CAIXABANK SA 14/07/2028 FRN EMTN | EUR | 417.087,04 | 0,03 |
| 500.000 | CAIXABANK SA 17/04/2030 FRN EMTN | EUR | 526.552,84 | 0,04 |
| 600.000 | CAIXABANK SA 18/06/2031 FRN EMTN | EUR | 607.422,34 | 0,05 |
| 500.000 | CAIXABANK SA 2.375% 01/02/2024 EMTN | EUR | 528.745,02 | 0,04 |
| 350.000 | CAIXABANK SA 4.125% 24/03/2036 | EUR | 530.874,99 | 0,04 |
| 450.000 | CAIXABANK SA 4.500% 26/04/2022 | EUR | 462.607,37 | 0,04 |
| 600.000 | CEDULAS TDA 6 FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS 3.875% 23/05/2025 | EUR | 689.457,19 | 0,06 |
| 400.000 | DEUTSCHE BANK SA ESPANOLA 0.625% 15/12/2021 EMTN | EUR | 400.890,72 | 0,03 |
| 830.811 | DRIVER ESPANA SIX FT -6 A 25/09/2030 FRN | EUR | 834.674,70 | 0,07 |
| 200.000 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 1.875% 04/12/2034 | EUR | 199.482,40 | 0,02 |
| 600.000 | PITCH1 5.125% 20/07/2022 | EUR | 626.287,43 | 0,05 |
| 800.000 | PROGRAMA CEDULAS TDA FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS 4.250% 10/04/2031 | EUR | 1.103.485,97 | 0,09 |
| 800.000 | RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU 0.375% 24/07/2028 EMTN | EUR | 813.412,47 | 0,07 |
| 500.000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.500% 14/11/2026 EMTN | EUR | 507.600,65 | 0,04 |
| 300.000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.875% 30/05/2023 EMTN | EUR | 305.988,00 | 0,02 |
| 7.100.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.400% 30/04/2028 | EUR | 7.758.811,77 | 0,62 |
| 19.753.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.450% 30/04/2029 | EUR | 21.761.032,70 | 1,76 |
| 3.390.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.450% 31/10/2027 | EUR | 3.707.608,63 | 0,30 |
| 7.001.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.600% 30/04/2025 | EUR | 7.513.942,83 | 0,60 |
| 6.565.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.850% 30/07/2035 | EUR | 7.529.584,29 | 0,61 |
| 8.832.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.950% 30/04/2026 | EUR | 9.742.995,54 | 0,79 |
| 3.200.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 2.150% 31/10/2025 | EUR | 3.531.642,98 | 0,28 |
| 3.510.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 2.350% 30/07/2033 | EUR | 4.223.168,54 | 0,34 |
| 4.000.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 2.750% 31/10/2024 | EUR | 4.401.113,64 | 0,35 |
| 3.073.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 2.900% 31/10/2046 | EUR | 4.208.690,70 | 0,34 |
| 1.598.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 3.450% 30/07/2066 | EUR | 2.454.012,79 | 0,20 |
| 400.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 4.650% 30/07/2025 | EUR | 478.111,96 | 0,04 |
| 4.571.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 4.700% 30/07/2041 | EUR | 7.615.175,11 | 0,61 |
| 4.776.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 4.800% 31/01/2024 | EUR | 5.372.121,02 | 0,43 |
| 400.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 5.150% 31/10/2044 | EUR | 729.640,85 | 0,06 |
| 6.951.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 5.750% 30/07/2032 | EUR | 10.847.623,42 | 0,87 |
| 9.040.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 5.850% 31/01/2022 | EUR | 9.231.588,34 | 0,75 |
| 900.000 | WIZINK MASTER CREDIT CARDS FT 2019-2 A 28/03/2033 FRN | EUR | 900.256,09 | 0,07 |
| | | | **129.280.443,51** | **10,40** |
| | **Niederlande** | | | |
| 700.000 | ABN AMRO BANK NV 1.125% 23/04/2039 | EUR | 774.939,51 | 0,06 |
| 110.000 | AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY FINANCING BV 1.125% 11/01/2029 EMTN | EUR | 112.153,28 | 0,01 |
| 270.000 | ALLIANDER NV FRN PERP | EUR | 280.564,03 | 0,02 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 800.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 1.125% 17/09/2025 | EUR | 835.880,58 | 0,07 |
| 170.000 | ASR NEDERLAND NV 02/05/2049 FRN | EUR | 190.764,64 | 0,02 |
| 1.530.000 | ATRADIUS FINANCE BV 23/09/2044 FRN | EUR | 1.707.848,56 | 0,14 |
| 1.600.000 | BAYER CAPITAL CORP BV 1.500% 26/06/2026 | EUR | 1.691.817,60 | 0,14 |
| 1.425.000 | BMW FINANCE NV 0.625% 06/10/2023 EMTN | EUR | 1.451.499,53 | 0,12 |
| 210.000 | BMW FINANCE NV 1.250% 05/09/2022 EMTN | EUR | 213.295,71 | 0,02 |
| 130.000 | BRENNTAG FINANCE BV 1.125% 27/09/2025 | EUR | 135.254,17 | 0,01 |
| 1.543.596 | BUMPER NL 2020-1 BV -2020-NL1 A 24/06/2031 FRN | EUR | 1.557.904,67 | 0,13 |
| 1.500.000 | COCA-COLA HBC FINANCE BV 0.625% 21/11/2029 | EUR | 1.516.352,22 | 0,12 |
| 800.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.625% 26/04/2026 EMTN | EUR | 831.768,13 | 0,07 |
| 700.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.875% 01/02/2029 | EUR | 745.887,05 | 0,06 |
| 200.000 | CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN | EUR | 202.576,36 | 0,02 |
| 795.000 | CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN | EUR | 797.788,30 | 0,06 |
| 400.000 | CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN | EUR | 395.793,00 | 0,03 |
| 135.000 | CTP NV 2.125% 01/10/2025 EMTN | EUR | 144.009,62 | 0,01 |
| 531.000 | DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN | EUR | 526.817,08 | 0,04 |
| 399.000 | DANFOSS FINANCE II BV 0.750% 28/04/2031 EMTN | EUR | 398.080,60 | 0,03 |
| 200.000 | DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN | EUR | 201.405,55 | 0,02 |
| 400.000 | DE VOLKSBANK NV 0.500% 30/01/2026 EMTN | EUR | 412.981,94 | 0,03 |
| 200.000 | DE VOLKSBANK NV 0.750% 24/10/2031 EMTN | EUR | 211.719,51 | 0,02 |
| 1.500.000 | DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN | EUR | 1.573.917,53 | 0,13 |
| 585.416 | DELFT 2020 BV 2020-1 A 17/10/2042 FRN | EUR | 585.468,50 | 0,05 |
| 1.200.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 0.875% 30/01/2024 EMTN | EUR | 1.231.358,40 | 0,10 |
| 1.000.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 03/04/2028 EMTN | EUR | 1.084.066,53 | 0,09 |
| 380.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032 | EUR | 372.449,66 | 0,03 |
| 100.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030 | EUR | 105.038,71 | 0,01 |
| 317.000 | DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031 | EUR | 303.199,91 | 0,02 |
| 726.739 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2017-1 BV 2017-1 A 28/01/2048 FRN | EUR | 728.175,39 | 0,06 |
| 668.588 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2018-1 BV 2018-1 A 28/04/2051 FRN | EUR | 669.514,46 | 0,05 |
| 389.438 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2019-1 BV 2019-1 A 28/10/2052 FRN | EUR | 390.650,82 | 0,03 |
| 551.682 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2020-1 BV 2020-1 A 28/07/2054 FRN | EUR | 553.421,56 | 0,04 |
| 309.645 | DUTCH RESIDENTIAL MORTGAGE PORTFOLIO II BV -2 A 26/09/2048 FRN | EUR | 310.514,99 | 0,02 |
| 969.000 | EDP FINANCE BV 0.375% 16/09/2026 EMTN | EUR | 980.025,93 | 0,08 |
| 335.000 | EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN | EUR | 360.191,50 | 0,03 |
| 1.850.000 | ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP | EUR | 1.986.437,50 | 0,16 |
| 1.255.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.500% 17/06/2030 EMTN | EUR | 1.249.583,83 | 0,10 |
| 370.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.000% 16/09/2024 EMTN | EUR | 382.252,65 | 0,03 |
| 200.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN | EUR | 209.871,25 | 0,02 |
| 1.300.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN | EUR | 1.982.689,20 | 0,16 |
| 245.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.000% 22/04/2027 | EUR | 256.900,79 | 0,02 |
| 210.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.625% 22/04/2032 | EUR | 230.648,40 | 0,02 |
| 653.562 | GREEN APPLE 2017-I NHG 2017-1 A 17/03/2056 FRN | EUR | 658.344,43 | 0,05 |
| 1.008.355 | GREEN APPLE 2018-1 NHG BV 2018-1 A 17/01/2057 FRN | EUR | 1.016.087,01 | 0,08 |
| 1.800.000 | GREEN APPLE 2021-I BV 2021-1 A 17/07/2028 FRN | EUR | 1.849.175,77 | 0,15 |
| 1.100.000 | GREEN STORM 2018 BV 2018-GRN A 22/05/2065 FRN | EUR | 1.108.528,87 | 0,09 |
| 600.000 | GREEN STORM 2021 BV 2021-GRN A 22/02/2068 FRN | EUR | 616.744,67 | 0,05 |
| 287.000 | HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.750% 06/09/2029 EMTN | EUR | 280.072,01 | 0,02 |
| 400.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 403.712,10 | 0,03 |
| 500.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 501.911,69 | 0,04 |
| 600.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 612.969,03 | 0,05 |
| 1.300.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 1.342.250,00 | 0,11 |
| 500.000 | ING BANK NV 0.750% 18/02/2029 EMTN | EUR | 528.860,91 | 0,04 |
| 500.000 | ING GROEP NV 18/02/2029 FRN | EUR | 489.896,35 | 0,04 |
| 200.000 | ING GROEP NV 22/03/2030 FRN | EUR | 210.451,37 | 0,02 |
| 1.100.000 | ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN | EUR | 1.166.912,38 | 0,09 |
| 410.000 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 0.250% 26/06/2025 | EUR | 414.694,36 | 0,03 |
| 1.070.000 | KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN | EUR | 1.081.799,68 | 0,09 |
| 1.200.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 1.375% 02/05/2028 | EUR | 1.288.777,22 | 0,10 |
| 1.800.000 | LINDE FINANCE BV 0.550% 19/05/2032 EMTN | EUR | 1.822.119,61 | 0,15 |
| 748.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 0.875% 17/09/2026 | EUR | 770.882,23 | 0,06 |
| 519.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 1.625% 17/09/2031 | EUR | 559.661,49 | 0,05 |
| 600.000 | MONDELEZ INTERNATIONAL HOLDINGS NETHERLANDS BV 0.625% 09/09/2032 | EUR | 585.251,95 | 0,05 |
| 200.000 | NATURGY FINANCE BV 1.250% 19/04/2026 EMTN | EUR | 210.173,77 | 0,02 |
| 1.000.000 | NATURGY FINANCE BV 1.375% 19/01/2027 EMTN | EUR | 1.062.875,27 | 0,09 |
| 200.000 | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 0.500% 29/04/2030 EMTN | EUR | 207.957,66 | 0,02 |
| 200.000 | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 1.250% 27/05/2036 EMTN | EUR | 222.231,71 | 0,02 |
| 2.690.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2030 | EUR | 2.727.844,53 | 0,22 |
| 800.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.250% 15/07/2025 | EUR | 826.134,55 | 0,07 |
| 6.778.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/07/2026 | EUR | 7.118.424,30 | 0,56 |
| 5.900.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 1.750% 15/07/2023 | EUR | 6.162.963,06 | 0,49 |
| 500.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.250% 15/07/2022 | EUR | 511.568,12 | 0,04 |
| 1.164.511 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.500% 15/01/2033 | EUR | 1.496.992,26 | 0,12 |
| 2.364.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.750% 15/01/2047 | EUR | 3.809.057,74 | 0,31 |
| 750.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.750% 15/01/2023 | EUR | 793.393,31 | 0,06 |
| 1.232.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.750% 15/01/2042 | EUR | 2.099.086,50 | 0,17 |
| 3.333.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.000% 15/01/2037 | EUR | 5.294.939,65 | 0,42 |
| 200.000 | NIBC BANK NV 0.875% 08/07/2025 EMTN | EUR | 205.747,67 | 0,02 |
| 400.000 | NIBC BANK NV 1.000% 11/09/2028 EMTN | EUR | 426.581,54 | 0,03 |
| 250.000 | NIBC BANK NV 1.125% 19/04/2023 EMTN | EUR | 255.173,78 | 0,02 |
| 150.000 | NIBC BANK NV 1.500% 31/01/2022 EMTN | EUR | 150.889,49 | 0,01 |
| 800.000 | REN FINANCE BV 2.500% 12/02/2025 EMTN | EUR | 868.728,61 | 0,07 |
| 700.000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 0.250% 02/08/2027 EMTN | EUR | 702.706,12 | 0,06 |
| 500.000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV 2.250% 10/12/2026 EMTN | EUR | 556.787,86 | 0,04 |
| 1.167.165 | SAECURE 16 BV -16 A 30/10/2091 FRN | EUR | 1.174.747,63 | 0,09 |
| 155.000 | SAGAX EURO MTN NL BV 0.750% 26/01/2028 EMTN | EUR | 154.042,50 | 0,01 |
| 1.290.000 | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 07/04/2028 EMTN | EUR | 1.395.987,14 | 0,11 |
| 764.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 0.500% 05/09/2034 EMTN | EUR | 759.465,92 | 0,06 |
| 1.900.000 | SILVER ARROW ATHLON NL 2021-1 BV 2021-1 A 26/02/2025 FRN | EUR | 1.915.476,77 | 0,15 |
| 2.100.000 | STORM 2017-II BV 2017-2 A 22/05/2064 FRN | EUR | 2.106.244,79 | 0,17 |
| 1.300.000 | STORM 2019-I BV 2019-1 A 22/03/2066 FRN | EUR | 1.315.282,71 | 0,11 |
| 560.000 | TENNET HOLDING BV 0.500% 30/11/2040 EMTN | EUR | 507.564,10 | 0,04 |
| 895.635 | TULIP MORTGAGE FUNDING 2019-1 BV 2019-1 A 18/10/2056 FRN | EUR | 899.201,88 | 0,07 |
| 200.000 | VAN LANSCHOT KEMPEN NV 0.375% 31/03/2023 | EUR | 202.373,46 | 0,02 |
| 300.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 347.624,44 | 0,03 |
| 400.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 403.863,60 | 0,03 |
| 400.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 410.396,95 | 0,03 |
| 1.800.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.988.759,54 | 0,16 |
| 200.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 3.250% 18/11/2030 | EUR | 243.074,65 | 0,02 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 400.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 4.125% 16/11/2038 | EUR | 552.506,22 | 0,04 |
| 700.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN | EUR | 717.562,87 | 0,06 |
| 200.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.125% 14/09/2034 EMTN | EUR | 198.896,09 | 0,02 |
| 700.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.500% 14/01/2028 | EUR | 746.945,89 | 0,06 |
| 100.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.625% 07/10/2039 EMTN | EUR | 101.206,14 | 0,01 |
| 300.000 | VONOVIA FINANCE BV 2.250% 07/04/2030 | EUR | 338.099,78 | 0,03 |
| 200.000 | VONOVIA FINANCE BV 2.250% 15/12/2023 EMTN | EUR | 210.825,66 | 0,02 |
| | | | **100.592.988,51** | **8,09** |
| | **Belgien** | | | |
| 400.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN | EUR | 478.421,80 | 0,04 |
| 200.000 | BELFIUS BANK SA 0.010% 15/10/2025 EMTN | EUR | 200.152,53 | 0,02 |
| 700.000 | BELFIUS BANK SA 0.375% 24/10/2023 EMTN | EUR | 711.647,98 | 0,06 |
| 1.719.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.800% 22/06/2025 | EUR | 1.808.218,39 | 0,15 |
| 500.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.000% 22/06/2026 | EUR | 535.240,65 | 0,04 |
| 2.999.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.150% 22/06/2066 | EUR | 4.191.234,73 | 0,34 |
| 6.280.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.250% 22/06/2023 | EUR | 6.600.484,73 | 0,52 |
| 1.080.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.750% 22/06/2045 | EUR | 1.783.873,64 | 0,14 |
| 2.929.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.000% 28/03/2032 | EUR | 4.128.056,39 | 0,33 |
| 676.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.250% 28/09/2022 | EUR | 709.031,76 | 0,06 |
| 1.402.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.500% 28/03/2026 | EUR | 1.723.449,52 | 0,14 |
| 4.830.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.000% 28/03/2035 | EUR | 7.842.638,79 | 0,63 |
| 5.791.428 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.500% 28/03/2028 | EUR | 8.023.905,99 | 0,65 |
| 700.000 | BNP PARIBAS FORTIS SA ZCP 24/10/2023 EMTN | EUR | 706.181,90 | 0,06 |
| 400.000 | BNP PARIBAS FORTIS SA 0.500% 23/09/2024 EMTN | EUR | 410.362,15 | 0,03 |
| 1.000.000 | BUMPER BE NV/SA 2021-BE1 A 23/10/2031 FRN | EUR | 1.007.010,00 | 0,08 |
| 900.000 | KBC GROUP NV 07/12/2031 FRN EMTN | EUR | 894.912,01 | 0,07 |
| 500.000 | MINISTERIES VAN DE VLAAMSE GEMEENSCHAP 1.341% 12/06/2025 EMTN | EUR | 531.245,03 | 0,04 |
| 200.000 | MINISTERIES VAN DE VLAAMSE GEMEENSCHAP 1.875% 02/06/2042 EMTN | EUR | 240.600,32 | 0,02 |
| | | | **42.526.668,31** | **3,42** |
| | **Irland** | | | |
| 400.000 | AIB GROUP PLC 1.250% 28/05/2024 EMTN | EUR | 413.850,20 | 0,03 |
| 644.000 | AIB GROUP PLC 17/11/2027 FRN EMTN | EUR | 646.551,21 | 0,05 |
| 840.000 | ARBOUR CLO VIII DAC -8X A 15/07/2033 FRN | EUR | 840.177,16 | 0,07 |
| 252.557 | ARDMORE SECURITIES NO 1 DAC 1 A 15/08/2057 FRN | EUR | 252.887,93 | 0,02 |
| 128.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 08/07/2024 FRN EMTN | EUR | 129.857,98 | 0,01 |
| 266.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 10/05/2027 FRN EMTN | EUR | 265.005,15 | 0,02 |
| 500.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 1.375% 29/08/2023 EMTN | EUR | 514.218,94 | 0,04 |
| 84.323 | BLUESTEP MORTGAGE SECURITIES NO 4 DAC -4 A 10/08/2066 FRN | EUR | 84.324,71 | 0,01 |
| 194.018 | CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2018-1 A 15/12/2027 FRN | EUR | 194.203,87 | 0,02 |
| 390.000 | CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2020-1 A 15/12/2029 FRN | EUR | 392.202,69 | 0,03 |
| 444.638 | DILOSK RMBS NO 3 DAC -3 A 20/10/2057 FRN | EUR | 445.367,08 | 0,04 |
| 300.863 | EOS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 35 DAC -35X A 23/04/2029 FRN | EUR | 301.424,64 | 0,02 |
| 412.604 | FASTNET SECURITIES 12 DAC -12 A 10/10/2056 FRN | EUR | 412.618,93 | 0,03 |
| 236.336 | FASTNET SECURITIES 13 DAC -13 A 18/04/2057 FRN | EUR | 236.712,73 | 0,02 |
| 671.901 | FINANCE IRELAND RMBS NO 1 DAC -1 A 24/06/2058 FRN | EUR | 672.954,05 | 0,05 |
| 917.218 | FINANCE IRELAND RMBS NO 2 DAC -2 A 24/09/2023 FRN | EUR | 920.512,50 | 0,07 |
| 916.584 | FINANCE IRELAND RMBS NO 3 DAC 3 A 24/06/2061 FRN | EUR | 924.908,09 | 0,07 |
| 794.950 | FINGAL SECURITIES RMBS DAC -1 A 28/07/2055 FRN | EUR | 799.703,57 | 0,06 |
| 600.000 | FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 2021 DAC 2021 A 15/10/2030 FRN | EUR | 602.214,00 | 0,05 |
| 328.505 | FROSN-2018 DAC 2018-1 A1 21/05/2028 FRN | EUR | 328.943,16 | 0,03 |
| 900.000 | GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING UNLIMITED CO 4.625% 22/02/2027 EMTN | EUR | 1.104.623,88 | 0,09 |
| 1.520.185 | GLENBEIGH 2 ISSUER DAC -1X A 24/03/2046 FRN | EUR | 1.521.181,87 | 0,12 |
| 123.000 | HAMMERSON IRELAND FINANCE DAC 1.750% 03/06/2027 | EUR | 124.387,44 | 0,01 |
| 850.000 | HENLEY CLO III DAC -3X A 25/01/2034 FRN | EUR | 850.891,06 | 0,07 |
| 3.800.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 0.800% 15/03/2022 | EUR | 3.824.838,21 | 0,31 |
| 1.988.379 | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.300% 15/05/2033 | EUR | 2.228.110,44 | 0,18 |
| 880.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.500% 15/05/2050 | EUR | 1.013.282,25 | 0,08 |
| 774.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 2.000% 18/02/2045 | EUR | 987.209,36 | 0,08 |
| 2.045.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 2.400% 15/05/2030 | EUR | 2.472.494,00 | 0,20 |
| 600.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 3.400% 18/03/2024 | EUR | 659.437,18 | 0,05 |
| 3.900.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 5.400% 13/03/2025 | EUR | 4.704.784,38 | 0,39 |
| 915.407 | KANAAL CMBS FINANCE 2019 DAC 2019-1 A 22/08/2028 FRN | EUR | 916.277,96 | 0,07 |
| 520.000 | KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 0.625% 20/09/2029 | EUR | 523.596,01 | 0,04 |
| 2.000.000 | KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 2.375% 10/09/2025 | EUR | 2.181.330,58 | 0,18 |
| 893.220 | MULCAIR SECURITIES DAC -1 A 24/04/2071 FRN | EUR | 895.530,51 | 0,07 |
| 418.008 | ORANJE EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 32 DAC -32 A 22/11/2028 FRN | EUR | 419.053,78 | 0,03 |
| 1.650.000 | PARTNERRE IRELAND FINANCE DAC 1.250% 15/09/2026 | EUR | 1.723.753,76 | 0,14 |
| 873.852 | PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 A 24/03/2061 FRN | EUR | 874.654,43 | 0,07 |
| 194.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 0.500% 22/09/2029 | EUR | 192.896,88 | 0,02 |
| 248.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033 | EUR | 246.636,33 | 0,02 |
| 571.875 | TAURUS 2019-1 FR DAC 2019-1FR A 02/02/2031 FRN | EUR | 571.640,63 | 0,05 |
| 147.000 | TAURUS 2019-4 FIN DAC 2019-FIN4 A 18/11/2031 FRN | EUR | 147.258,78 | 0,01 |
| 477.628 | TAURUS 2020-1 NL DAC 2020-NL1X A 20/02/2030 FRN | EUR | 478.543,30 | 0,04 |
| | | | **38.041.051,61** | **3,06** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 728.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.400% 15/02/2027 | EUR | 725.575,62 | 0,06 |
| 1.120.000 | AT&T INC 1.600% 19/05/2028 | EUR | 1.199.293,96 | 0,10 |
| 785.000 | AT&T INC 1.800% 05/09/2026 | EUR | 844.123,21 | 0,07 |
| 415.000 | AT&T INC 3.150% 04/09/2036 | EUR | 503.901,10 | 0,04 |
| 400.000 | BANK OF AMERICA CORP 07/02/2025 FRN EMTN | EUR | 414.068,21 | 0,03 |
| 500.000 | BANK OF AMERICA CORP 0.750% 26/07/2023 EMTN | EUR | 509.635,63 | 0,04 |
| 374.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/03/2031 FRN EMTN | EUR | 373.110,80 | 0,03 |
| 300.000 | BMW US CAPITAL LLC 1.000% 20/04/2027 EMTN | EUR | 315.825,62 | 0,03 |
| 1.161.000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 1.250% 11/02/2025 | EUR | 1.201.994,78 | 0,10 |
| 200.000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 2.125% 01/03/2027 | EUR | 216.733,92 | 0,02 |
| 420.000 | CITIGROUP INC 06/07/2026 FRN EMTN | EUR | 437.353,74 | 0,04 |
| 447.000 | CITIGROUP INC 08/10/2027 FRN EMTN | EUR | 450.858,31 | 0,04 |
| 200.000 | CITIGROUP INC 24/07/2026 FRN EMTN | EUR | 210.261,70 | 0,02 |
| 1.500.000 | COMCAST CORP 0.750% 20/02/2032 | EUR | 1.513.289,16 | 0,12 |
| 1.096.000 | EMERSON ELECTRIC CO 1.250% 15/10/2025 EMTN | EUR | 1.150.589,71 | 0,09 |
| 1.351.000 | EMERSON ELECTRIC CO 2.000% 15/10/2029 EMTN | EUR | 1.519.608,50 | 0,12 |
| 1.109.000 | EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033 | EUR | 1.102.289,97 | 0,09 |
| 797.000 | EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FUNDING 0.600% 16/06/2028 EMTN | EUR | 801.380,78 | 0,06 |
| 1.200.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 15/05/2024 EMTN | EUR | 1.229.206,90 | 0,10 |
| 800.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN | EUR | 801.664,81 | 0,06 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 675.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.300% 11/02/2028 | EUR | 676.860,60 | 0,05 |
| 800.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.950% 23/05/2025 | EUR | 829.669,66 | 0,07 |
| 580.000 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026 | EUR | 622.267,41 | 0,05 |
| 2.300.000 | JPMORGAN CHASE & CO 11/03/2027 FRN EMTN | EUR | 2.390.660,71 | 0,18 |
| 300.000 | JPMORGAN CHASE & CO 24/02/2028 FRN EMTN | EUR | 300.849,84 | 0,02 |
| 1.080.000 | LINDE INC/CT 1.625% 01/12/2025 | EUR | 1.160.497,56 | 0,09 |
| 1.700.000 | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 0.375% 09/04/2024 | EUR | 1.727.839,37 | 0,14 |
| 550.000 | MORGAN STANLEY 1.750% 11/03/2024 GMTN | EUR | 575.941,10 | 0,05 |
| 910.000 | MORGAN STANLEY 1.750% 30/01/2025 GMTN | EUR | 964.389,00 | 0,08 |
| 247.000 | MORGAN STANLEY 23/10/2026 FRN EMTN | EUR | 259.166,33 | 0,02 |
| 1.400.000 | MORGAN STANLEY 29/10/2027 FRN | EUR | 1.408.333,92 | 0,11 |
| 125.000 | NASDAQ INC 0.875% 13/02/2030 | EUR | 126.882,71 | 0,01 |
| 909.000 | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 23/01/2027 GMTN | EUR | 916.767,19 | 0,07 |
| 2.010.000 | PARKER-HANNIFIN CORP 1.125% 01/03/2025 | EUR | 2.075.544,87 | 0,17 |
| 485.000 | PEPSICO INC 0.400% 09/10/2032 | EUR | 474.270,36 | 0,04 |
| 265.000 | PEPSICO INC 0.875% 16/10/2039 | EUR | 261.304,15 | 0,02 |
| 400.000 | PROCTER & GAMBLE CO 2.000% 05/11/2021 | EUR | 400.884,95 | 0,03 |
| 285.000 | PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.375% 06/02/2028 | EUR | 286.847,67 | 0,02 |
| 230.000 | PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.500% 16/02/2032 | EUR | 223.277,33 | 0,02 |
| 1.379.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.375% 22/03/2029 | EUR | 1.369.904,09 | 0,11 |
| 583.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035 | EUR | 578.019,24 | 0,05 |
| 200.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030 | EUR | 211.005,66 | 0,02 |
| 700.000 | WELLS FARGO & CO 0.500% 26/04/2024 EMTN | EUR | 710.968,54 | 0,06 |
| 300.000 | WELLS FARGO & CO 1.000% 02/02/2027 EMTN | EUR | 310.699,84 | 0,02 |
| 200.000 | WELLS FARGO & CO 2.625% 16/08/2022 EMTN | EUR | 205.327,09 | 0,02 |
| | | | **34.588.945,62** | **2,78** |
| | **Österreich** | | | |
| 2.540.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2031 | EUR | 2.535.245,25 | 0,20 |
| 500.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.750% 20/10/2026 | EUR | 531.056,67 | 0,04 |
| 1.000.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.500% 20/02/2047 | EUR | 1.222.114,96 | 0,10 |
| 2.020.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.750% 20/10/2023 | EUR | 2.123.573,70 | 0,17 |
| 100.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.400% 23/05/2034 | EUR | 127.774,13 | 0,01 |
| 880.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.150% 20/06/2044 | EUR | 1.390.249,85 | 0,11 |
| 250.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.400% 22/11/2022 | EUR | 261.699,00 | 0,02 |
| 5.410.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.650% 20/04/2022 | EUR | 5.538.565,03 | 0,45 |
| 1.797.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.800% 26/01/2062 | EUR | 3.719.690,48 | 0,30 |
| 2.008.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.150% 15/03/2037 | EUR | 3.189.767,56 | 0,26 |
| 250.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.850% 15/03/2026 | EUR | 311.410,36 | 0,03 |
| 3.845.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 6.250% 15/07/2027 | EUR | 5.350.167,78 | 0,43 |
| 900.000 | AUSTRIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 10/01/2024 | DEM | 532.029,19 | 0,04 |
| 400.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.100% 15/01/2030 EMTN | EUR | 401.251,27 | 0,03 |
| 1.100.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.250% 26/06/2024 EMTN | EUR | 1.119.126,87 | 0,09 |
| 600.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.375% 16/04/2024 EMTN | EUR | 609.442,60 | 0,05 |
| 1.000.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.625% 18/01/2027 EMTN | EUR | 1.042.832,77 | 0,08 |
| 200.000 | ERSTE GROUP BANK AG 08/09/2031 FRN EMTN | EUR | 207.601,80 | 0,02 |
| 700.000 | ERSTE GROUP BANK AG 10/06/2030 FRN EMTN | EUR | 708.919,12 | 0,06 |
| 1.100.000 | ERSTE GROUP BANK AG 16/11/2028 FRN EMTN | EUR | 1.084.587,03 | 0,09 |
| 100.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.375% 25/09/2026 EMTN | EUR | 101.471,52 | 0,01 |
| 700.000 | TELEKOM FINANZMANAGEMENT GMBH 1.500% 07/12/2026 | EUR | 750.430,49 | 0,06 |
| 400.000 | UNICREDIT BANK AUSTRIA AG 0.625% 20/03/2029 EMTN | EUR | 418.697,19 | 0,03 |
| | | | **33.277.704,62** | **2,68** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 400.000 | AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.125% 07/10/2026 | EUR | 407.123,65 | 0,03 |
| 400.000 | AFRICAN DEVELOPMENT BANK 0.250% 24/01/2024 | EUR | 406.415,78 | 0,03 |
| 500.000 | EUROFIMA 3.125% 15/11/2022 EMTN | EUR | 520.199,96 | 0,04 |
| 3.460.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.750% 15/09/2045 EMTN | EUR | 4.356.416,70 | 0,36 |
| 7.575.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.000% 15/10/2037 | EUR | 11.862.348,57 | 0,96 |
| 400.000 | EUROPEAN STABILITY MECHANISM 1.750% 20/10/2045 EMTN | EUR | 508.047,58 | 0,04 |
| 2.540.000 | EUROPEAN UNION ZCP 04/07/2031 | EUR | 2.537.893,83 | 0,20 |
| 2.800.000 | EUROPEAN UNION ZCP 04/07/2035 | EUR | 2.693.340,64 | 0,22 |
| 2.100.000 | EUROPEAN UNION 0.100% 04/10/2040 | EUR | 1.961.755,26 | 0,16 |
| 150.000 | EUROPEAN UNION 0.750% 04/04/2031 EMTN | EUR | 160.775,76 | 0,01 |
| 300.000 | EUROPEAN UNION 1.500% 04/10/2035 EMTN | EUR | 348.130,92 | 0,03 |
| 300.000 | EUROPEAN UNION 3.375% 04/04/2032 EMTN | EUR | 402.576,86 | 0,03 |
| 200.000 | INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0.500% 16/04/2030 | EUR | 207.835,77 | 0,02 |
| 200.000 | INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0.625% 12/01/2033 | EUR | 208.862,62 | 0,02 |
| 250.000 | NORDIC INVESTMENT BANK 0.125% 10/06/2024 EMTN | EUR | 254.130,01 | 0,02 |
| | | | **26.835.853,91** | **2,17** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 100.000 | AROUNDTOWN SA 1.450% 09/07/2028 EMTN | EUR | 104.600,92 | 0,01 |
| 100.000 | AROUNDTOWN SA 1.625% 31/01/2028 EMTN | EUR | 105.630,94 | 0,01 |
| 542.100 | CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGES BLUE SA BLUE A 18/07/2044 FRN | EUR | 544.601,37 | 0,04 |
| 760.500 | CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGES 4 SA -4 A 25/11/2054 FRN | EUR | 765.384,38 | 0,06 |
| 180.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.750% 25/03/2027 EMTN | EUR | 192.197,74 | 0,02 |
| 1.945.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN | EUR | 2.074.405,25 | 0,17 |
| 1.298.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031 | EUR | 1.308.060,47 | 0,11 |
| 2.800.000 | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 3.375% 03/04/2037 EMTN | EUR | 4.061.134,64 | 0,32 |
| 766.500 | FACT MASTER SA 2021-1 A 20/07/2028 FRN | EUR | 772.364,53 | 0,06 |
| 400.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA FRN PERP EMTN | EUR | 394.000,00 | 0,03 |
| 200.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 0.125% 11/01/2028 EMTN | EUR | 193.468,25 | 0,02 |
| 200.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 1.375% 03/08/2026 EMTN | EUR | 209.962,15 | 0,02 |
| 200.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 1.500% 22/02/2027 EMTN | EUR | 211.116,78 | 0,02 |
| 700.000 | HANNOVER FINANCE LUXEMBOURG SA 30/06/2043 FRN | EUR | 759.144,80 | 0,06 |
| 393.000 | HARMAN FINANCE INTERNATIONAL SCA 2.000% 27/05/2022 | EUR | 396.637,66 | 0,03 |
| 400.000 | HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.625% 07/04/2026 EMTN | EUR | 425.507,82 | 0,03 |
| 117.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 23/04/2031 | EUR | 113.490,87 | 0,01 |
| 555.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 29/11/2026 EMTN | EUR | 564.477,04 | 0,05 |
| 727.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.625% 19/01/2033 EMTN | EUR | 696.712,15 | 0,06 |
| 517.000 | JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN | EUR | 607.413,52 | 0,05 |
| 427.000 | LOGICOR FINANCING SARL 0.875% 14/01/2031 EMTN | EUR | 413.111,94 | 0,03 |
| 683.000 | LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15/07/2027 EMTN | EUR | 719.120,00 | 0,06 |
| 100.000 | LOGICOR FINANCING SARL 2.250% 13/05/2025 EMTN | EUR | 106.827,82 | 0,01 |
| 200.000 | LOGICOR FINANCING SARL 3.250% 13/11/2028 EMTN | EUR | 231.291,82 | 0,02 |
| 660.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.375% 15/10/2028 | EUR | 663.697,09 | 0,05 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.500.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.750% 15/10/2032 | EUR | 1.509.818,97 | 0,12 |
| 530.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.000% 02/07/2031 | EUR | 552.176,72 | 0,04 |
| 407.348 | MIRAVET SARL - COMPARTMENT 2020-1 2020-1 A 26/05/2065 FRN | EUR | 408.325,79 | 0,03 |
| 1.056.447 | MIRAVET SARL 2019-1 A 26/05/2065 FRN | EUR | 1.057.601,79 | 0,09 |
| 500.000 | NESTLE FINANCE INTERNATIONAL LTD 1.750% 12/09/2022 EMTN | EUR | 510.498,35 | 0,04 |
| 129.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN | EUR | 138.413,15 | 0,01 |
| 2.300.000 | SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2020-1 2020-1 A 14/11/2031 FRN | EUR | 2.323.248,47 | 0,18 |
| 208.000 | SEGRO CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031 | EUR | 203.573,05 | 0,02 |
| 225.000 | SELP FINANCE SARL 1.500% 20/12/2026 | EUR | 236.724,93 | 0,02 |
| 400.000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN | EUR | 403.085,46 | 0,03 |
| 612.000 | TYCO ELECTRONICS GROUP SA ZCP 16/02/2029 | EUR | 594.488,43 | 0,05 |
| | | | **24.572.315,06** | **1,98** |
| | **Finnland** | | | |
| 1.200.000 | ELENIA VERKKO OYJ 0.375% 06/02/2027 EMTN | EUR | 1.205.450,98 | 0,10 |
| 1.500.000 | FINGRID OYJ 3.500% 03/04/2024 EMTN | EUR | 1.639.729,23 | 0,13 |
| 1.370.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 0.250% 15/09/2040 | EUR | 1.329.370,96 | 0,11 |
| 500.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 0.750% 15/04/2031 | EUR | 537.626,16 | 0,04 |
| 500.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 1.500% 15/04/2023 | EUR | 517.132,18 | 0,04 |
| 300.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 1.625% 15/09/2022 | EUR | 306.694,32 | 0,02 |
| 2.360.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 2.000% 15/04/2024 | EUR | 2.523.656,30 | 0,21 |
| 962.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 2.625% 04/07/2042 | EUR | 1.390.413,97 | 0,11 |
| 2.190.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 2.750% 04/07/2028 | EUR | 2.650.510,66 | 0,21 |
| 360.000 | OP CORPORATE BANK PLC 0.100% 16/11/2027 EMTN | EUR | 358.070,33 | 0,03 |
| 674.000 | OP CORPORATE BANK PLC 09/06/2030 FRN | EUR | 698.196,65 | 0,06 |
| 480.000 | SAMPO OYJ 23/05/2049 FRN | EUR | 547.237,39 | 0,04 |
| 300.000 | SATO OYJ 1.375% 24/02/2028 | EUR | 312.056,03 | 0,03 |
| 300.000 | UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN | EUR | 294.971,21 | 0,02 |
| | | | **14.311.116,37** | **1,15** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 100.000 | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 1.625% 11/03/2026 EMTN | EUR | 105.281,97 | 0,01 |
| 490.000 | AVIVA PLC 04/12/2045 FRN EMTN | EUR | 544.159,32 | 0,04 |
| 480.000 | BARCLAYS PLC 09/06/2025 FRN EMTN | EUR | 488.728,65 | 0,04 |
| 1.000.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 2.625% 06/11/2023 EMTN | EUR | 1.052.907,19 | 0,08 |
| 98.090 | GREAT HALL MORTGAGES NO 1 PLC 2006-1 A2B 18/06/2038 FRN | EUR | 97.415,22 | 0,01 |
| 800.000 | HSBC HOLDINGS PLC 24/09/2029 FRN | EUR | 796.689,44 | 0,06 |
| 128.000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0.375% 28/01/2025 EMTN | EUR | 129.739,10 | 0,01 |
| 275.000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 2.375% 09/04/2026 EMTN | EUR | 303.020,42 | 0,02 |
| 1.250.000 | LLOYDS BANK PLC 4.875% 13/01/2023 EMTN | EUR | 1.335.191,40 | 0,11 |
| 200.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 01/04/2026 FRN EMTN | EUR | 223.834,00 | 0,02 |
| 500.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 12/11/2025 FRN EMTN | EUR | 507.188,63 | 0,04 |
| 695.000 | NATIONAL WESTMINSTER BANK PLC 0.500% 15/05/2024 EMTN | EUR | 710.080,30 | 0,06 |
| 100.000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 0.625% 25/03/2027 EMTN | EUR | 104.186,57 | 0,01 |
| 300.000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 1.125% 31/05/2028 EMTN | EUR | 322.971,10 | 0,03 |
| 210.000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 1.375% 29/06/2032 EMTN | EUR | 234.898,43 | 0,02 |
| 507.000 | NATWEST GROUP PLC 04/03/2025 FRN EMTN | EUR | 531.243,66 | 0,04 |
| 506.000 | NATWEST GROUP PLC 26/02/2030 FRN EMTN | EUR | 505.729,90 | 0,04 |
| 100.000 | NATWEST MARKETS PLC 2.750% 02/04/2025 EMTN | EUR | 109.630,63 | 0,01 |
| 600.000 | RENTOKIL INITIAL PLC 0.500% 14/10/2028 EMTN | EUR | 603.499,83 | 0,05 |
| 475.000 | SANTANDER UK PLC 0.050% 12/01/2027 GMTN | EUR | 478.503,13 | 0,04 |
| 500.000 | SANTANDER UK PLC 0.375% 20/09/2023 | EUR | 507.626,12 | 0,04 |
| 600.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.375% 27/07/2029 EMTN | EUR | 588.017,74 | 0,05 |
| 365.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN | EUR | 375.268,10 | 0,03 |
| 1.280.000 | VODAFONE GROUP PLC 1.125% 20/11/2025 EMTN | EUR | 1.338.158,77 | 0,10 |
| 180.000 | VODAFONE GROUP PLC 2.200% 25/08/2026 EMTN | EUR | 198.347,31 | 0,02 |
| | | | **12.192.316,93** | **0,98** |
| | **Australien** | | | |
| 585.000 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD 0.250% 29/11/2022 GMTN | EUR | 589.995,12 | 0,05 |
| 515.000 | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.500% 27/07/2026 EMTN | EUR | 531.688,62 | 0,04 |
| 500.000 | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 0.875% 19/02/2029 EMTN | EUR | 529.654,65 | 0,04 |
| 1.000.000 | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 3.000% 03/05/2022 EMTN | EUR | 1.020.372,86 | 0,08 |
| 211.568 | LIBERTY FUNDING PTY LTD 2018-1 A1C 10/10/2049 FRN | EUR | 211.587,94 | 0,02 |
| 165.169 | LIBERTY SERIES 2017-4 2017-4 A1C 25/04/2049 FRN | EUR | 165.196,29 | 0,01 |
| 513.625 | PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST NO 22 22X A1GE 20/06/2060 FRN | EUR | 493.253,28 | 0,04 |
| 173.391 | PEPPER RESIDENTIAL SECURITIES TRUST NO 25 25X A1GE 12/03/2061 FRN | EUR | 172.491,25 | 0,01 |
| 171.000 | TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 2.280% 21/10/2027 EMTN | EUR | 192.436,04 | 0,02 |
| 1.600.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.875% 16/09/2024 EMTN | EUR | 1.684.772,10 | 0,14 |
| 1.000.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 3.000% 08/04/2030 EMTN | EUR | 1.177.123,91 | 0,09 |
| 816.000 | WESTPAC BANKING CORP 0.375% 02/04/2026 EMTN | EUR | 836.080,25 | 0,07 |
| 300.000 | WESTPAC BANKING CORP 0.375% 05/03/2023 EMTN | EUR | 303.464,75 | 0,02 |
| 465.000 | WESTPAC BANKING CORP 13/05/2031 FRN | EUR | 465.211,90 | 0,04 |
| | | | **8.373.328,96** | **0,67** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 440.000 | ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 0.125% 22/09/2023 EMTN | EUR | 444.549,17 | 0,04 |
| 1.900.000 | ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 0.625% 27/01/2022 | EUR | 1.906.835,55 | 0,14 |
| 825.000 | ASB FINANCE LTD 0.250% 08/09/2028 EMTN | EUR | 815.832,50 | 0,07 |
| 1.200.000 | ASB FINANCE LTD/LONDON 0.250% 21/05/2031 EMTN | EUR | 1.197.559,58 | 0,10 |
| 595.000 | BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.375% 14/09/2024 GMTN | EUR | 604.593,95 | 0,05 |
| 220.000 | BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.500% 13/05/2023 GMTN | EUR | 223.049,77 | 0,02 |
| 1.000.000 | BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.625% 03/07/2025 | EUR | 1.032.062,16 | 0,08 |
| 875.000 | WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.250% 06/04/2022 EMTN | EUR | 878.349,67 | 0,07 |
| | | | **7.102.832,35** | **0,57** |
| | **Schweiz** | | | |
| 719.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 02/04/2026 FRN EMTN | EUR | 792.381,97 | 0,06 |
| 172.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 0.650% 10/09/2029 EMTN | EUR | 169.604,08 | 0,01 |
| 800.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 14/01/2028 FRN EMTN | EUR | 800.081,40 | 0,06 |
| 700.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 17/07/2025 FRN EMTN | EUR | 720.395,11 | 0,06 |
| 800.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 24/06/2027 FRN EMTN | EUR | 819.861,50 | 0,07 |
| 700.000 | UBS AG/LONDON 0.010% 31/03/2026 EMTN | EUR | 698.262,57 | 0,06 |
| 2.137.000 | UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN | EUR | 2.118.915,59 | 0,17 |
| 805.000 | UBS GROUP AG 29/01/2026 FRN EMTN | EUR | 810.189,14 | 0,07 |
| | | | **6.929.691,36** | **0,56** |
| | **Kanada** | | | |
| 1.959.000 | FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028 | EUR | 2.169.957,36 | 0,16 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 700.000 | ROYAL BANK OF CANADA 0.050% 19/06/2026 EMTN | EUR | 707.352,70 | 0,06 |
| 800.000 | ROYAL BANK OF CANADA 0.625% 10/09/2025 GMTN | EUR | 827.898,26 | 0,07 |
| 700.000 | ROYAL BANK OF CANADA 0.875% 17/06/2022 | EUR | 706.854,82 | 0,06 |
| 1.000.000 | TORONTO-DOMINION BANK/THE ZCP 09/02/2024 | EUR | 1.009.027,52 | 0,08 |
| 700.000 | TORONTO-DOMINION BANK/THE 0.250% 27/04/2022 | EUR | 702.989,53 | 0,06 |
| | | | **6.124.080,19** | **0,49** |
| | **Japan** | | | |
| 1.800.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.541% 23/10/2028 | EUR | 1.811.891,65 | 0,14 |
| 300.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.375% 09/07/2032 | EUR | 313.593,83 | 0,03 |
| 2.105.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.250% 21/11/2026 | EUR | 2.320.282,73 | 0,18 |
| 900.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030 | EUR | 1.076.593,19 | 0,09 |
| | | | **5.522.361,40** | **0,44** |
| | **Norwegen** | | | |
| 800.000 | DNB BANK ASA 0.050% 14/11/2023 EMTN | EUR | 806.877,98 | 0,06 |
| 700.000 | DNB BANK ASA 01/03/2027 FRN EMTN | EUR | 703.726,08 | 0,06 |
| 746.000 | DNB BANK ASA 0.250% 09/04/2024 | EUR | 756.532,39 | 0,06 |
| 1.052.000 | DNB BOLIGKREDITT AS 0.010% 21/01/2031 | EUR | 1.039.344,67 | 0,08 |
| 1.800.000 | DNB BOLIGKREDITT AS 0.250% 07/09/2026 EMTN | EUR | 1.838.817,83 | 0,16 |
| 295.000 | STATKRAFT AS 1.125% 20/03/2025 EMTN | EUR | 306.542,57 | 0,02 |
| | | | **5.451.841,52** | **0,44** |
| | **Portugal** | | | |
| 400.000 | BANCO COMERCIAL PORTUGUES SA 0.750% 31/05/2022 | EUR | 403.286,64 | 0,03 |
| 1.900.000 | BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN | EUR | 2.123.046,89 | 0,17 |
| 1.320.000 | PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 4.100% 15/04/2037 | EUR | 1.983.204,38 | 0,16 |
| | | | **4.509.537,91** | **0,36** |
| | **Polen** | | | |
| 2.450.000 | POLAND GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.500% 09/09/2025 EMTN | EUR | 2.615.986,28 | 0,21 |
| 1.500.000 | POLAND GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.000% 08/03/2049 EMTN | EUR | 1.856.497,40 | 0,15 |
| | | | **4.472.483,68** | **0,36** |
| | **Schweden** | | | |
| 400.000 | ESSITY AB 0.500% 03/02/2030 | EUR | 400.016,48 | 0,03 |
| 300.000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.875% 23/01/2026 | EUR | 316.998,71 | 0,03 |
| 535.000 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB 0.375% 09/02/2026 | EUR | 549.565,34 | 0,04 |
| 200.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.125% 18/06/2024 EMTN | EUR | 202.407,99 | 0,02 |
| 385.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.000% 15/04/2025 EMTN | EUR | 401.119,02 | 0,03 |
| 1.695.000 | TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON 1.00% 26/05/2029 EMTN | EUR | 1.705.918,53 | 0,14 |
| | | | **3.576.026,07** | **0,29** |
| | **Singapur** | | | |
| 500.000 | DBS BANK LTD 0.375% 23/01/2024 | EUR | 508.380,47 | 0,04 |
| 1.540.000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD 11/04/2028 FRN GMTN | EUR | 1.575.258,44 | 0,12 |
| 800.000 | UNITED OVERSEAS BANK LTD 0.250% 11/09/2023 EMTN | EUR | 809.992,35 | 0,07 |
| | | | **2.893.631,26** | **0,23** |
| | **Island** | | | |
| 164.000 | ARION BANKI HF 1.625% 01/12/2021 EMTN | EUR | 164.466,17 | 0,01 |
| 1.000.000 | ISLANDSBANKI HF 1.125% 12/04/2022 GMTN | EUR | 1.006.590,22 | 0,08 |
| 900.000 | ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN | EUR | 912.545,96 | 0,07 |
| 700.000 | LANDSBANKINN HF 0.500% 20/05/2024 EMTN | EUR | 706.739,85 | 0,06 |
| | | | **2.790.342,20** | **0,22** |
| | **Jersey** | | | |
| 300.000 | EURO-DM SECURITIES LTD ZCP 08/04/2026 | DEM | 152.245,38 | 0,01 |
| 550.000 | GLENCORE FINANCE EUROPE LTD 1.750% 17/03/2025 EMTN | EUR | 576.189,14 | 0,05 |
| | | | **728.434,52** | **0,06** |
| | **Lettland** | | | |
| 300.000 | LATVIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.375% 07/10/2026 | EUR | 308.905,87 | 0,03 |
| 200.000 | LATVIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.375% 16/05/2036 | EUR | 229.892,46 | 0,02 |
| | | | **538.798,33** | **0,05** |
| | **Dänemark** | | | |
| 210.000 | JYSKE BANK AS 15/10/2025 FRN EMTN | EUR | 212.232,77 | 0,02 |
| 300.000 | JYSKE REALKREDIT AS 0.500% 01/10/2026 | EUR | 309.989,35 | 0,02 |
| | | | **522.222,12** | **0,04** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 360.000 | XLIT LTD 29/06/2047 FRN | EUR | 404.211,70 | 0,03 |
| | | | **404.211,70** | **0,03** |
| | **Israel** | | | |
| 100.000 | ISRAEL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.500% 18/01/2027 EMTN | EUR | 107.581,61 | 0,01 |
| 250.000 | ISRAEL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 29/01/2024 EMTN | EUR | 268.181,78 | 0,02 |
| | | | **375.763,39** | **0,03** |
| | **Litauen** | | | |
| 300.000 | LITHUANIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.125% 22/10/2035 EMTN | EUR | 375.000,00 | 0,03 |
| | | | **375.000,00** | **0,03** |
| | **Guernsey** | | | |
| 300.000 | CREDIT SUISSE GROUP FUNDING GUERNSEY LTD 1.250% 14/04/2022 EMTN | EUR | 302.358,76 | 0,02 |
| | | | **302.358,76** | **0,02** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 200.000 | EP INFRASTRUCTURE AS 2.045% 09/10/2028 | EUR | 211.337,44 | 0,02 |
| | | | **211.337,44** | **0,02** |
| | **Slowakei** | | | |
| 50.000 | SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.875% 09/03/2037 | EUR | 60.277,81 | 0,00 |
| | | | **60.277,81** | **0,00** |
| | | | **1.065.118.176,96** | **85,65** |

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

### Anleihen und andere Schuldtitel

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 400.000 | INTERNATIONAL BANK FOR RECONSTRUCTION & DEVELOPMENT 0.500% 20/12/2022 EMTN | EUR | 401.872,34 | 0,03 |
| | | | **401.872,34** | **0,03** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Fixed Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Frankreich** | | | |
| 33.126 | FCT GINKGO COMPARTMENT SALES FINANCE 2017-1 2017-SF1 A 25/11/2044 FRN | EUR | 33.144,61 | 0,00 |
| | | | **33.144,61** | **0,00** |
| | | | **435.016,95** | **0,03** |
| | **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | |
| | **Offene Fonds** | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 10.274 | NN (L) AAA ABS - Z CAP EUR | EUR | 53.511.204,34 | 4,30 |
| 4.964 | NN (L) EUROPEAN ABS - Z CAP EUR | EUR | 27.152.931,08 | 2,18 |
| 40.930 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 40.549.505,55 | 3,27 |
| | | | **121.213.640,97** | **9,75** |
| | | | **121.213.640,97** | **9,75** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **1.186.766.834,88** | **95,43** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | **Credit Default Swaps** | | | |
| CDX ITRAXX EUROPE SERIES 36 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2026 | EUR | 86.350.000,00 | 2.254.754,79 |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 35 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/06/2026 | EUR | 86.350.000,00 | 2.252.172,93 |
| | | | | | | **4.506.927,72** |

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| | | **Zinsswaps** | | | |
| 1.456 | Floating | 03/11/2035 | EUR | 6.600.000,00 | 1.004.886,63 |
| Floating | 0.078 | 15/04/2031 | EUR | 105.706.000,00 | 604.124,59 |
| 1.539 | Floating | 01/08/2037 | EUR | 3.400.000,00 | 593.050,41 |
| 0.960 | Floating | 27/11/2024 | EUR | 10.000.000,00 | 412.302,90 |
| 0.525 | Floating | 13/05/2026 | EUR | 10.545.000,00 | 363.835,29 |
| 0.503 | Floating | 13/03/2024 | EUR | 13.700.000,00 | 304.687,18 |
| 1.068 | Floating | 11/02/2036 | EUR | 3.100.000,00 | 303.994,12 |
| 0.570 | Floating | 01/08/2024 | EUR | 8.500.000,00 | 226.472,22 |
| 0.726 | Floating | 11/08/2036 | EUR | 3.900.000,00 | 188.399,37 |
| 0.196 | Floating | 02/11/2023 | EUR | 10.000.000,00 | 130.662,10 |
| 0.062 | Floating | 24/10/2029 | EUR | 12.000.000,00 | 21.686,28 |
| -0.046 | Floating | 17/10/2029 | EUR | 25.400.000,00 | (174.886,62) |
| 0.277 | Floating | 02/08/2051 | EUR | 12.060.000,00 | (729.863,00) |
| | | | | | **3.249.351,47** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| | | **Total Return Swap** | | | |
| 281.757 | TRS BARCLAYS EURO AGGREGATE BOND INDEX | 17/11/2021 | EUR | 75.000.000,00 | 810.811,86 |
| | | | | | **810.811,86** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| 1.168 | EURO-BTP FUTURE 08/12/2021 | EUR | 177.477.600,00 | (2.615.194,63) |
| 975 | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 165.574.500,00 | 118.389,37 |
| (280) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 56.935.200,00 | 1.898.389,79 |
| (1.068) | EURO-OAT FUTURE 08/12/2021 | EUR | 177.234.600,00 | 1.055.470,49 |
| | | | **577.221.900,00** | **457.055,02** |
| | **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | **9.024.146,07** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **1.186.766.834,88** | **95,43** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **9.024.146,07** | **0,73** |
| **Bankguthaben** | **42.620.944,76** | **3,43** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **5.217.183,90** | **0,41** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **1.243.629.109,61** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 754.916.345,16 |
| | 30.09.2020 | EUR | 547.488.734,49 |
| | 30.09.2019 | EUR | 767.775.771,30 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 800,67 |
| | 30.09.2020 | EUR | 612,06 |
| | 30.09.2019 | EUR | 655,47 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 726,36 |
| | 30.09.2020 | EUR | 555,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 595,65 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 676,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 521,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 564,54 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 142,28 |
| | 30.09.2020 | USD | 111,14 |
| | 30.09.2019 | USD | 111,75 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 327,00 |
| | 30.09.2020 | CHF | 252,49 |
| | 30.09.2019 | CHF | 273,18 |
| Capitalisation P Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 408,45 |
| | 30.09.2020 | USD | 311,79 |
| | 30.09.2019 | USD | 328,46 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 387,57 |
| | 30.09.2020 | EUR | 296,99 |
| | 30.09.2019 | EUR | 318,81 |
| Capitalisation R Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 381,07 |
| | 30.09.2020 | CHF | 292,16 |
| | 30.09.2019 | CHF | 313,95 |
| Capitalisation R Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 436,26 |
| | 30.09.2020 | USD | 330,77 |
| | 30.09.2019 | USD | 345,98 |
| Capitalisation U (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 8.479,91 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.474,50 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.925,46 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 278,16 |
| | 30.09.2020 | EUR | 214,55 |
| | 30.09.2019 | EUR | 231,85 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 610,18 |
| | 30.09.2020 | EUR | 473,44 |
| | 30.09.2019 | EUR | 514,62 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 567,54 |
| | 30.09.2020 | EUR | 445,81 |
| | 30.09.2019 | EUR | 492,68 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.499,27 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.178,76 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.303,88 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.395,27 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.107,02 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.235,78 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 328,88 |
| | 30.09.2020 | EUR | 258,96 |
| | 30.09.2019 | EUR | 286,87 |
| Distribution X (M) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 306,03 |
| | 30.09.2020 | EUR | 244,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 274,98 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 319,12 |
| | 30.09.2020 | AUD | 253,94 |
| | 30.09.2019 | AUD | 287,33 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 329,25 |
| | 30.09.2020 | USD | 259,27 |
| | 30.09.2019 | USD | 282,55 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 268,60 |
| | 30.09.2020 | EUR | 217,25 |
| | 30.09.2019 | EUR | 246,94 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 282,33 |
| | 30.09.2020 | AUD | 227,26 |
| | 30.09.2019 | AUD | 259,41 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 307,26 |
| | 30.09.2020 | USD | 244,51 |
| | 30.09.2019 | USD | 269,09 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 391.599 |
| | 30.09.2020 | 354.741 |
| | 30.09.2019 | 456.456 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 440 |
| | 30.09.2020 | 751 |
| | 30.09.2019 | 1.042 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 171.176 |
| | 30.09.2020 | 200.180 |
| | 30.09.2019 | 227.181 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1.725 |
| | 30.09.2020 | 3.329 |
| | 30.09.2019 | 5.926 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 20 |
| | 30.09.2020 | 58 |
| | 30.09.2019 | 390 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation P Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 9.790 |
| | 30.09.2020 | 25.489 |
| | 30.09.2019 | 24.130 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 41.859 |
| | 30.09.2020 | 34.942 |
| | 30.09.2019 | 45.712 |
| Capitalisation R Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 4.127 |
| | 30.09.2020 | 4.430 |
| | 30.09.2019 | 5.247 |
| Capitalisation R Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 22.824 |
| | 30.09.2020 | 15.469 |
| | 30.09.2019 | 9.518 |
| Capitalisation U (EUR) | 30.09.2021 | 427 |
| | 30.09.2020 | 672 |
| | 30.09.2019 | 581 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 594.251 |
| | 30.09.2020 | 503.067 |
| | 30.09.2019 | 779.182 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 45.043 |
| | 30.09.2020 | 51.736 |
| | 30.09.2019 | 60.254 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 31.988 |
| | 30.09.2020 | 49.914 |
| | 30.09.2019 | 83.378 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 718 |
| | 30.09.2020 | 641 |
| | 30.09.2019 | 579 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 18.916 |
| | 30.09.2020 | 21.638 |
| | 30.09.2019 | 22.846 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 13.759 |
| | 30.09.2020 | 9.603 |
| | 30.09.2019 | 12.984 |
| Distribution X (M) (EUR) | 30.09.2021 | 7.896 |
| | 30.09.2020 | 8.315 |
| | 30.09.2019 | 5.933 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 15.654 |
| | 30.09.2020 | 16.498 |
| | 30.09.2019 | 20.799 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 31.891 |
| | 30.09.2020 | 25.532 |
| | 30.09.2019 | 39.340 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution Y (M) (EUR) | 30.09.2021 | 22.876 |
| | 30.09.2020 | 22.116 |
| | 30.09.2019 | 18.843 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 19.494 |
| | 30.09.2020 | 1.329 |
| | 30.09.2019 | 4.659 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 93.061 |
| | 30.09.2020 | 4.604 |
| | 30.09.2019 | 9.018 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 12,95 |
| Distribution N (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 34,20 |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 32,20 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 7,50 |
| Distribution X (M) (EUR) | 02.09.2021 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 03.08.2021 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 02.07.2021 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 02.06.2021 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 04.05.2021 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 08.04.2021 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 02.03.2021 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 02.02.2021 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 05.01.2021 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 02.12.2020 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 03.11.2020 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) (EUR) | 06.10.2020 | EUR | 0,70 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,67 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 08.04.2021 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 06.10.2020 | AUD | 0,67 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 08.04.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,65 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 06.10.2020 | USD | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 02.09.2021 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 03.08.2021 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 02.07.2021 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 02.06.2021 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 04.05.2021 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 08.04.2021 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 02.03.2021 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 02.02.2021 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 05.01.2021 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 02.12.2020 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 03.11.2020 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) (EUR) | 06.10.2020 | EUR | 0,65 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 08.04.2021 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 06.10.2020 | AUD | 0,62 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 08.04.2021 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 06.10.2020 | USD | 0,64 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| **Laufende Kosten in %*** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,79% |
| Capitalisation P Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation P Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 1,07% |
| Capitalisation R Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 1,07% |
| Capitalisation U (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 1,71% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution X (M) (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution Y (M) (EUR) | 30.09.2021 | 3,30% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 3,33% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 3,33% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 215,79% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **727.187.300,37** |
| Aktien | | 727.187.300,37 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **1.062.305,12** |
| Devisentermingeschäfte | | 1.062.305,12 |
| **Bankguthaben** | | **46.521.570,77** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **14.197.109,66** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***788.968.285,92*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(34.051.940,76)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(34.051.940,76)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***754.916.345,16*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **18.359.083,08** |
| Dividenden | | 18.359.083,08 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(9.440.097,79)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (7.557.787,45) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.617.446,88) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (6.445,45) |
| Abonnementsteuer | 9 | (163.672,32) |
| Bankzinsen | | (94.745,69) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **8.918.985,29** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 124.093.268,08 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (14.826.463,64) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 681.861,50 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (51.216,48) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 212.322,21 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (220.439,88) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 55.490.168,32 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 671.080,68 |
| **Ergebnis** | | **174.969.566,08** |
| Zeichnungen | | 284.267.539,17 |
| Rücknahmen | | (249.838.468,84) |
| Ausschüttung | | (1.971.025,74) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 547.488.734,49 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***754.916.345,16*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| | **Frankreich** | | | |
| 113.222 | AMUNDI SA | EUR | 8.253.883,80 | 1,09 |
| 466.608 | BNP PARIBAS SA | EUR | 25.868.747,52 | 3,43 |
| 62.361 | CAPGEMINI SE | EUR | 11.234.334,15 | 1,49 |
| 100.711 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA | EUR | 13.374.420,80 | 1,77 |
| 353.384 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 20.581.084,16 | 2,73 |
| 1.135.666 | ENGIE SA | EUR | 12.880.723,77 | 1,70 |
| 31.267 | KERING SA | EUR | 19.260.472,00 | 2,55 |
| 60.549 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 37.546.434,90 | 4,97 |
| 128.570 | PERNOD RICARD SA | EUR | 24.518.299,00 | 3,25 |
| 575.055 | REXEL SA | EUR | 9.640.797,08 | 1,28 |
| 285.540 | SANOFI | EUR | 23.722.663,20 | 3,14 |
| 235.246 | SCOR SE | EUR | 5.897.617,22 | 0,78 |
| 145.774 | SOCIETE GENERALE SA | EUR | 3.964.323,93 | 0,53 |
| 623.553 | TOTALENERGIES SE | EUR | 25.774.563,26 | 3,41 |
| 203.139 | VINCI SA | EUR | 18.312.980,85 | 2,43 |
| | | | **260.831.345,64** | **34,55** |
| | **Deutschland** | | | |
| 43.535 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 8.482.359,40 | 1,12 |
| 206.742 | COVESTRO AG | EUR | 12.268.070,28 | 1,63 |
| 147.911 | DAIMLER AG - REG | EUR | 11.347.731,92 | 1,50 |
| 44.018 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 6.184.529,00 | 0,82 |
| 279.674 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 15.236.639,52 | 2,02 |
| 1.197.869 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 20.838.129,12 | 2,77 |
| 1.225.103 | E.ON SE | EUR | 12.946.888,50 | 1,73 |
| 233.170 | EVONIK INDUSTRIES AG | EUR | 6.358.545,90 | 0,84 |
| 702.320 | INFINEON TECHNOLOGIES AG | EUR | 24.949.918,00 | 3,30 |
| 36.439 | LEG IMMOBILIEN SE | EUR | 4.452.845,80 | 0,59 |
| 19.760 | MERCK KGAA | EUR | 3.707.964,00 | 0,49 |
| 64.200 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 15.208.980,00 | 2,01 |
| 186.930 | SAP SE | EUR | 21.848.378,40 | 2,89 |
| 265.897 | SIEMENS AG - REG | EUR | 37.736.102,24 | 5,00 |
| 321.377 | SIEMENS HEALTHINEERS AG | EUR | 18.054.959,86 | 2,39 |
| 106.185 | STROEER SE & CO KGAA | EUR | 7.570.990,50 | 1,00 |
| | | | **227.193.032,44** | **30,10** |
| | **Niederlande** | | | |
| 1.389.388 | AEGON NV | EUR | 6.206.396,20 | 0,82 |
| 193.083 | AIRBUS SE | EUR | 22.223.853,30 | 2,94 |
| 173.691 | HEINEKEN NV | EUR | 15.666.928,20 | 2,08 |
| 551.941 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 15.860.024,64 | 2,10 |
| 1.815.587 | STELLANTIS NV | EUR | 30.095.170,11 | 3,99 |
| | | | **90.052.372,45** | **11,93** |
| | **Italien** | | | |
| 10.177.474 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 24.970.432,46 | 3,31 |
| 1.285.942 | UNICREDIT SPA | EUR | 14.788.333,00 | 1,96 |
| | | | **39.758.765,46** | **5,27** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 751.106 | ROYAL DUTCH SHELL PLC - A | EUR | 14.595.491,79 | 1,92 |
| 266.450 | UNILEVER PLC | EUR | 12.428.560,25 | 1,65 |
| | | | **27.024.052,04** | **3,57** |
| | **Finnland** | | | |
| 1.737.575 | NORDEA BANK ABP | EUR | 19.533.818,15 | 2,58 |
| 237.258 | UPM-KYMMENE OYJ | EUR | 7.286.193,18 | 0,97 |
| | | | **26.820.011,33** | **3,55** |
| | **Irland** | | | |
| 271.442 | CRH PLC | EUR | 11.009.687,52 | 1,46 |
| 249.828 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 11.337.194,64 | 1,50 |
| | | | **22.346.882,16** | **2,96** |
| | **Belgien** | | | |
| 127.577 | UCB SA | EUR | 12.349.453,60 | 1,64 |
| | | | **12.349.453,60** | **1,64** |
| | **Spanien** | | | |
| 987.820 | IBERDROLA SA | EUR | 8.578.228,88 | 1,14 |
| | | | **8.578.228,88** | **1,14** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 136.519 | APERAM SA | EUR | 6.536.529,72 | 0,87 |
| | | | **6.536.529,72** | **0,87** |
| | **Portugal** | | | |
| 1.256.147 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA | EUR | 5.696.626,65 | 0,75 |
| | | | **5.696.626,65** | **0,75** |
| | | | **727.187.300,37** | **96,33** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **727.187.300,37** | **96,33** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 54.261.739,65 | USD | 45.756.676,44 | EUR | 19/10/2021 | 45.756.676,44 | 1.049.253,08 |
| 11.029.070,11 | AUD | 6.854.362,32 | EUR | 19/10/2021 | 6.854.362,32 | 18.240,24 |
| 1.608.528,34 | CHF | 1.484.349,21 | EUR | 19/10/2021 | 1.484.349,21 | 3.612,56 |
| 346.407,45 | USD | 296.746,86 | EUR | 01/10/2021 | 296.746,86 | 2.150,81 |
| 34.534,06 | AUD | 21.372,07 | EUR | 05/10/2021 | 21.372,07 | 151,95 |
| 7.660,77 | USD | 6.595,30 | EUR | 04/10/2021 | 6.595,30 | 14,80 |
| 3.906,50 | EUR | 6.301,76 | AUD | 01/10/2021 | 3.906,50 | (21,27) |
| 24.153,92 | EUR | 28.055,98 | USD | 05/10/2021 | 24.153,92 | (53,70) |
| 8.951,72 | EUR | 10.449,79 | USD | 01/10/2021 | 8.951,72 | (64,88) |
| 122.355,90 | EUR | 142.122,49 | USD | 04/10/2021 | 122.355,90 | (274,49) |
| 197.920,94 | EUR | 318.499,69 | AUD | 19/10/2021 | 197.920,94 | (547,45) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 676.946,20 | EUR | 796.552,70 | USD | 19/10/2021 | 676.946,20 | (10.156,53) |
| | | | | | **55.454.337,38** | **1.062.305,12** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **1.062.305,12** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **727.187.300,37** | **96,33** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **1.062.305,12** | **0,14** |
| **Bankguthaben** | **46.521.570,77** | **6,16** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(19.854.831,10)** | **(2,63)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **754.916.345,16** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 35.129.220,87 |
| | 30.09.2020 | EUR | 37.441.683,20 |
| | 30.09.2019 | EUR | 52.761.830,82 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 385,17 |
| | 30.09.2020 | EUR | 300,14 |
| | 30.09.2019 | EUR | 340,77 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 277,20 |
| | 30.09.2020 | EUR | 214,39 |
| | 30.09.2019 | EUR | 241,59 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.435,50 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.124,23 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.282,79 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 127,17 |
| | 30.09.2020 | EUR | 107,02 |
| | 30.09.2019 | EUR | 130,49 |
| Distribution P (Q) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 128,22 |
| | 30.09.2020 | EUR | 106,73 |
| | 30.09.2019 | EUR | 130,48 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 214,56 |
| | 30.09.2020 | EUR | 180,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 220,39 |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 526,53 |
| | 30.09.2020 | EUR | 442,71 |
| | 30.09.2019 | EUR | 539,71 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 43.670 |
| | 30.09.2020 | | 56.985 |
| | 30.09.2019 | | 66.935 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 713 |
| | 30.09.2020 | | 998 |
| | 30.09.2019 | | 2.256 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 889 |
| | 30.09.2020 | | 947 |
| | 30.09.2019 | | 1.043 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 125.377 |
| | 30.09.2020 | | 170.037 |
| | 30.09.2019 | | 205.277 |
| Distribution P (Q) (EUR) | 30.09.2021 | | 972 |
| | 30.09.2020 | | 972 |
| | 30.09.2019 | | 972 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 644 |
| | 30.09.2020 | 1.225 |
| | 30.09.2019 | 2.594 |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | 1.194 |
| | 30.09.2020 | 1.212 |
| | 30.09.2019 | 1.082 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Dividende** | | | |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 8,30 |
| Distribution P (Q) (EUR) | 27.09.2021 | EUR | 2,24 |
| Distribution P (Q) (EUR) | 25.06.2021 | EUR | 2,16 |
| Distribution P (Q) (EUR) | 26.03.2021 | EUR | 1,95 |
| Distribution P (Q) (EUR) | 28.12.2020 | EUR | 1,87 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 15,45 |
| Distribution X (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 31,75 |

| | | |
|---|---|---|
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P (Q) (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 166,56% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **34.412.924,94** |
| Aktien | | 34.194.539,99 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 218.384,95 |
| **Bankguthaben** | | **135.451,42** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **884.384,10** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **2.588.176,19** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***38.020.936,65*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(2.720.059,30)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(171.656,48)** |
| Optionen | | (22.269,15) |
| Futures | | (149.387,33) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(2.891.715,78)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***35.129.220,87*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **1.015.888,54** |
| Dividenden | | 1.004.437,02 |
| Sonstige Erträge | 10 | 11.451,52 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(669.952,46)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (555.400,79) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (91.608,40) |
| Abonnementsteuer | 9 | (18.167,17) |
| Bankzinsen | | (4.776,10) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **345.936,08** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 6.121.818,08 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.486.204,27) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 1.832.795,13 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.957.650,34) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 76,59 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 4.425.549,02 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (156.446,21) |
| **Ergebnis** | | **9.125.874,08** |
| Zeichnungen | | 708.837,52 |
| Rücknahmen | | (10.734.141,38) |
| Ausschüttung | | (1.413.032,55) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 37.441.683,20 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***35.129.220,87*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Frankreich** | | | | |
| 2.088 | AIR LIQUIDE SA | EUR | 289.355,04 | 0,82 |
| 9.895 | AMUNDI SA | EUR | 721.345,50 | 2,05 |
| 15.525 | BNP PARIBAS SA | EUR | 860.706,00 | 2,45 |
| 14.891 | BOUYGUES SA | EUR | 534.586,90 | 1,52 |
| 349 | CAPGEMINI SE | EUR | 62.872,35 | 0,18 |
| 18.359 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 1.069.228,16 | 3,04 |
| 36.786 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 439.445,56 | 1,26 |
| 22.663 | ENGIE SA | EUR | 257.043,75 | 0,73 |
| 1.316 | KERING SA | EUR | 810.656,00 | 2,31 |
| 2.307 | L'OREAL SA | EUR | 823.252,95 | 2,34 |
| 3.431 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 2.127.563,10 | 6,06 |
| 320 | PUBLICIS GROUPE SA | EUR | 18.643,20 | 0,05 |
| 34.941 | REXEL SA | EUR | 585.785,87 | 1,67 |
| 15.835 | SANOFI | EUR | 1.315.571,80 | 3,74 |
| 398 | TELEPERFORMANCE | EUR | 135.359,80 | 0,39 |
| 3.211 | TOTALENERGIES SE | EUR | 132.726,69 | 0,38 |
| 419 | VINCI SA | EUR | 37.772,85 | 0,11 |
| 31.867 | VIVENDI SE | EUR | 347.509,64 | 0,99 |
| | | | **10.569.425,16** | **30,09** |
| **Deutschland** | | | | |
| 2.293 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 446.768,12 | 1,27 |
| 13.112 | COVESTRO AG | EUR | 778.066,08 | 2,21 |
| 15.067 | DAIMLER AG - REG | EUR | 1.155.940,24 | 3,29 |
| 21.414 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 1.166.634,72 | 3,32 |
| 65.856 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 1.145.630,98 | 3,27 |
| 82.427 | E.ON SE | EUR | 871.088,54 | 2,49 |
| 2.090 | LEG IMMOBILIEN SE | EUR | 255.398,00 | 0,73 |
| 2.065 | MERCK KGAA | EUR | 387.497,25 | 1,10 |
| 13.380 | SAP SE | EUR | 1.563.854,40 | 4,45 |
| 10.379 | SIEMENS AG - REG | EUR | 1.472.987,68 | 4,19 |
| 6.592 | SIEMENS HEALTHINEERS AG | EUR | 370.338,56 | 1,05 |
| 2.843 | VOLKSWAGEN AG - PREF | EUR | 550.518,52 | 1,57 |
| | | | **10.164.723,09** | **28,94** |
| **Niederlande** | | | | |
| 105.056 | AEGON NV | EUR | 469.285,15 | 1,33 |
| 4.762 | ASML HOLDING NV | EUR | 3.075.775,80 | 8,76 |
| 3.598 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 142.192,96 | 0,40 |
| 3.654 | HEINEKEN NV | EUR | 329.590,80 | 0,94 |
| 27.706 | ING GROEP NV | EUR | 348.209,01 | 0,99 |
| 35.908 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 1.031.816,38 | 2,94 |
| 3.049 | PROSUS NV | EUR | 210.350,51 | 0,60 |
| 35.559 | STELLANTIS NV | EUR | 589.425,98 | 1,68 |
| | | | **6.196.646,59** | **17,64** |
| **Italien** | | | | |
| 78.430 | ENI SPA | EUR | 905.552,78 | 2,58 |
| 427.534 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 1.048.954,67 | 2,98 |
| 17.304 | UNICREDIT SPA | EUR | 198.996,00 | 0,57 |
| | | | **2.153.503,45** | **6,13** |
| **Spanien** | | | | |
| 33.867 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | EUR | 193.617,64 | 0,55 |
| 132.995 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 417.138,82 | 1,19 |
| 1.520 | ENDESA SA | EUR | 26.478,40 | 0,08 |
| 57.388 | IBERDROLA SA | EUR | 498.357,39 | 1,42 |
| 14.046 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 446.943,72 | 1,27 |
| 5.612 | REPSOL SA | EUR | 63.404,38 | 0,18 |
| | | | **1.645.940,35** | **4,69** |
| **Luxemburg** | | | | |
| 7.041 | APERAM SA | EUR | 337.123,08 | 0,96 |
| 25.193 | ARCELORMITTAL SA | EUR | 666.606,78 | 1,89 |
| 8.918 | TENARIS SA | EUR | 81.082,46 | 0,23 |
| | | | **1.084.812,32** | **3,08** |
| **Österreich** | | | | |
| 6.437 | ERSTE GROUP BANK AG | EUR | 244.992,22 | 0,70 |
| 11.704 | OMV AG | EUR | 610.714,72 | 1,73 |
| 3.994 | WIENERBERGER AG | EUR | 116.385,16 | 0,33 |
| | | | **972.092,10** | **2,76** |
| **Irland** | | | | |
| 7.195 | CRH PLC | EUR | 291.829,20 | 0,83 |
| 13.687 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 621.116,06 | 1,77 |
| | | | **912.945,26** | **2,60** |
| **Finnland** | | | | |
| 2.931 | KESKO OYJ - B | EUR | 87.461,04 | 0,25 |
| 7.865 | UPM-KYMMENE OYJ | EUR | 241.534,15 | 0,69 |
| | | | **328.995,19** | **0,94** |
| **Belgien** | | | | |
| 3.864 | AGEAS SA/NV | EUR | 165.456,48 | 0,47 |
| | | | **165.456,48** | **0,47** |
| | | | **34.194.539,99** | **97,34** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| **Luxemburg** | | | | |
| 220 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 218.384,95 | 0,62 |
| | | | **218.384,95** | **0,62** |
| | | | **218.384,95** | **0,62** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **34.412.924,94** | **97,96** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Marktwert in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Optionen** | | | | |
| (600) | CALL EURO STOXX 50 INDEX 29/09/2021 4215.00 | EUR | 2.428.848,00 | 0,00 |
| (500) | CALL EURO STOXX 50 INDEX 06/10/2021 4165.00 | EUR | 2.024.040,00 | (1.943,77) |
| (500) | CALL EURO STOXX 50 INDEX 13/10/2021 4135.00 | EUR | 2.024.040,00 | (9.732,29) |
| (400) | CALL EURO STOXX 50 INDEX 20/10/2021 4141.00 | EUR | 1.619.232,00 | (10.593,09) |
| | | | **8.096.160,00** | **(22.269,15)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Future auf Aktienindizes** | | | | |
| 172 | EURO STOXX 50 17/12/2021 | EUR | 6.962.560,00 | (149.387,33) |
| | | | **6.962.560,00** | **(149.387,33)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(171.656,48)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **34.412.924,94** | **97,96** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(171.656,48)** | **(0,49)** |
| **Bankguthaben** | **135.451,42** | **0,39** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **752.500,99** | **2,14** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **35.129.220,87** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Liquidity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 50.894.213,86 |
| | 30.09.2020 | EUR | 66.249.710,57 |
| | 30.09.2019 | EUR | 65.830.285,30 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.868,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.897,29 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.913,20 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 252,89 |
| | 30.09.2020 | EUR | 254,45 |
| | 30.09.2019 | EUR | 255,36 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 253,14 |
| | 30.09.2020 | EUR | 254,71 |
| | 30.09.2019 | EUR | 255,61 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 253,14 |
| | 30.09.2020 | EUR | 254,70 |
| | 30.09.2019 | EUR | 255,61 |
| Capitalisation S (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.132,66 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.162,84 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.179,58 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 250,54 |
| | 30.09.2020 | EUR | 252,09 |
| | 30.09.2019 | EUR | 252,98 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 995,11 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.001,31 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.004,87 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 996,25 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.002,40 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.005,96 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 996,22 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.002,38 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.005,94 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 375 |
| | 30.09.2020 | | 424 |
| | 30.09.2019 | | 423 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 20.071 |
| | 30.09.2020 | | 23.258 |
| | 30.09.2019 | | 14.630 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 104.803 |
| | 30.09.2020 | | 128.007 |
| | 30.09.2019 | | 142.681 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 16.500 |
| | 30.09.2020 | 24.282 |
| | 30.09.2019 | 25.946 |
| Capitalisation S (EUR) | 30.09.2021 | 63 |
| | 30.09.2020 | 73 |
| | 30.09.2019 | 73 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 25.915 |
| | 30.09.2020 | 39.029 |
| | 30.09.2019 | 29.555 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 38 |
| | 30.09.2020 | 59 |
| | 30.09.2019 | 81 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 723 |
| | 30.09.2020 | 1.876 |
| | 30.09.2019 | 2.263 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 5.733 |
| | 30.09.2020 | 7.293 |
| | 30.09.2019 | 6.660 |
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,14% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,17% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,17% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,17% |
| Capitalisation S (EUR) | 30.09.2021 | 0,14% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 0,17% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 0,17% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 0,17% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,17% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (32,53%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Liquidity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **46.475.605,78** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 2.433.882,41 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 5.513.994,64 |
| Geldmarktinstrumente | | 38.527.728,73 |
| **Bankguthaben** | | **4.641.985,26** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **58.211,52** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***51.175.802,56*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(281.588,70)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(281.588,70)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***50.894.213,86*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamtaufwendungen** | | **(342.854,10)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (5.710,47) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (84.964,61) |
| Abonnementsteuer | 9 | (5.283,84) |
| Bankzinsen | | (26.714,95) |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | (209.084,55) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (11.095,68) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(342.854,10)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 269,06 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (6.681,22) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 654,60 |
| **Ergebnis** | | **(348.611,66)** |
| Zeichnungen | | 8.862.329,70 |
| Rücknahmen | | (23.869.214,75) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 66.249.710,57 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***50.894.213,86*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Liquidity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 2.500.000 | PURPLE PROTECTED ASSET SA 12/04/2022 FRN | EUR | 2.493.950,00 | 4,90 |
| | | | **2.493.950,00** | **4,90** |
| | **Niederlande** | | | |
| 2.000.000 | ING GROEP NV 0.750% 09/03/2022 EMTN | EUR | 2.010.618,18 | 3,95 |
| | | | **2.010.618,18** | **3,95** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.000.000 | BARCLAYS PLC 1.500% 01/04/2022 EMTN | EUR | 1.009.426,46 | 1,99 |
| | | | **1.009.426,46** | **1,99** |
| | | | **5.513.994,64** | **10,84** |
| **Geldmarktinstrumente** | | | | |
| | **Frankreich** | | | |
| 2.000.000 | BNP PARIBAS SA ZCP 01/12/2021 | EUR | 2.001.845,78 | 3,93 |
| 500.000 | BNP PARIBAS SA 23/11/2021 | EUR | 500.402,68 | 0,98 |
| 1.500.000 | CDC HABITAT SA ZCP 03/01/2022 | EUR | 1.503.302,00 | 2,95 |
| 2.000.000 | LEGRAND FRANCE SA ZCP 25/10/2021 | EUR | 2.000.686,36 | 3,93 |
| 2.000.000 | METROPOLE DE LYON ZCP 31/01/2022 | EUR | 2.003.660,90 | 3,94 |
| 2.500.000 | REGION NORD PAS ZCP 20/10/2021 | EUR | 2.500.720,10 | 4,92 |
| 2.000.000 | SAGESS ZCP 25/11/2021 | EUR | 2.000.957,28 | 3,93 |
| 2.000.000 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA ZCP 27/10/2021 | EUR | 2.000.757,46 | 3,93 |
| | | | **14.512.332,56** | **28,51** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 2.000.000 | LAND SECURITIES GROUP PLC ZCP 19/10/2021 | EUR | 2.000.525,94 | 3,93 |
| 2.500.000 | LONDON STOCK ZCP 27/10/2021 | EUR | 2.500.856,50 | 4,91 |
| 1.500.000 | MITSUI & CO ZCP 06/10/2021 | EUR | 1.500.285,89 | 2,95 |
| 2.500.000 | QATAR NATIONAL BANK (Q.P.S.C.) ZCP 26/01/2022 (1) | EUR | 2.504.232,88 | 4,92 |
| | | | **8.505.901,21** | **16,71** |
| | **Deutschland** | | | |
| 2.500.000 | DEUTSCHE BANK AG ZCP 29/11/2021 | EUR | 2.500.962,25 | 4,91 |
| 1.000.000 | DEUTSCHE BOERSE ZCP 25/10/2021 | EUR | 1.000.336,51 | 1,97 |
| 2.000.000 | RWE AG ZCP 29/11/2021 | EUR | 2.001.426,08 | 3,93 |
| | | | **5.502.724,84** | **10,81** |
| | **Belgien** | | | |
| 1.000.000 | BRUSSELS MUNICIPALITIES REGIONAL FUND ZCP 25/02/2022 | EUR | 1.001.859,01 | 1,97 |
| 1.500.000 | BRUSSELS MUNICIPALITIES REGIONAL FUND ZCP 27/10/2021 | EUR | 1.500.535,58 | 2,95 |
| 2.000.000 | VLAAMSE GEMEENSCHAP ZCP 15/10/2021 | EUR | 2.000.401,88 | 3,93 |
| | | | **4.502.796,47** | **8,85** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 1.000.000 | DANAHER CORP ZCP 13/10/2021 | EUR | 1.000.162,36 | 1,97 |
| 2.000.000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC ZCP 11/10/2021 | EUR | 2.000.287,48 | 3,93 |
| | | | **3.000.449,84** | **5,90** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 1.500.000 | INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA ZCP 28/02/2022 (1) | EUR | 1.502.841,98 | 2,95 |
| | | | **1.502.841,98** | **2,95** |
| | **Niederlande** | | | |
| 1.000.000 | KONINKLIJKE FRIES ZCP 25/11/2021 | EUR | 1.000.681,83 | 1,97 |
| | | | **1.000.681,83** | **1,97** |
| | | | **38.527.728,73** | **75,70** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 2.457 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 2.433.882,41 | 4,78 |
| | | | **2.433.882,41** | **4,78** |
| | | | **2.433.882,41** | **4,78** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **46.475.605,78** | **91,32** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **46.475.605,78** | **91,32** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **0,00** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **4.641.985,26** | **9,12** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(223.377,18)** | **(0,44)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **50.894.213,86** | **100,00** |

(1) Kurzfristiges Einlagenzertifikat.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Long Duration Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 917.543.409,85 |
| | 30.09.2020 | EUR | 834.905.317,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 918.068.468,70 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 9.786,88 |
| | 30.09.2020 | EUR | 10.253,37 |
| | 30.09.2019 | EUR | 10.108,41 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 555,05 |
| | 30.09.2020 | EUR | 580,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 572,23 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 536,61 |
| | 30.09.2020 | EUR | 564,18 |
| | 30.09.2019 | EUR | 558,14 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 526,95 |
| | 30.09.2020 | EUR | 554,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 549,29 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 31.104 |
| | 30.09.2020 | | 25.296 |
| | 30.09.2019 | | 28.750 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 1.094.078 |
| | 30.09.2020 | | 979.878 |
| | 30.09.2019 | | 1.087.740 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 4.936 |
| | 30.09.2020 | | 6.164 |
| | 30.09.2019 | | 5.733 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 6.111 |
| | 30.09.2020 | | 5.009 |
| | 30.09.2019 | | 3.295 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,49% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 0,40% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 0,85% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 0,95% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | (5,26%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Long Duration Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **909.912.821,26** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 75.561.455,99 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 834.351.365,27 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **1.684.969,86** |
| Credit Default Swaps | | 1.684.969,86 |
| **Bankguthaben** | | **99.778,19** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **2.356.556,99** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **7.475.511,00** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***921.529.637,30*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(1.960.201,25)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(2.026.026,20)** |
| Zinsswaps | | (1.409.449,11) |
| Futures | | (616.577,09) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(3.986.227,45)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***917.543.409,85*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **13.424.930,11** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 11.459.431,94 |
| Zinsen auf Swaps | | 1.964.798,17 |
| Sonstige Erträge | 10 | 700,00 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(3.806.836,67)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.260.009,67) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.232.926,86) |
| Abonnementsteuer | 9 | (306.731,87) |
| Bankzinsen | | (7.168,27) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **9.618.093,44** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 23.474.142,49 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (120.430,37) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 17.928.208,66 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (25.771.812,03) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (61.930.571,40) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.606.913,21) |
| **Ergebnis** | | **(38.409.282,42)** |
| Zeichnungen | | 252.626.449,35 |
| Rücknahmen | | (131.579.074,80) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 834.905.317,72 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***917.543.409,85*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Long Duration Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Frankreich** | | | | |
| 1.100.000 | APRR SA 1.625% 13/01/2032 EMTN | EUR | 1.241.926,66 | 0,14 |
| 1.300.000 | APRR SA 1.875% 06/01/2031 EMTN | EUR | 1.491.244,50 | 0,16 |
| 200.000 | BNP PARIBAS SA 0.625% 03/12/2032 EMTN | EUR | 194.206,77 | 0,02 |
| 600.000 | BNP PARIBAS SA 1.625% 02/07/2031 EMTN | EUR | 631.548,25 | 0,07 |
| 400.000 | BPCE SFH SA 0.375% 18/03/2041 | EUR | 388.087,43 | 0,04 |
| 400.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.250% 11/05/2032 EMTN | EUR | 443.322,09 | 0,05 |
| 500.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 1.250% 22/01/2035 EMTN | EUR | 558.352,53 | 0,06 |
| 325.000 | CIE DE FINANCEMENT FONCIER SA 3.875% 25/04/2055 EMTN | EUR | 603.222,55 | 0,07 |
| 200.000 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA 0.250% 02/11/2032 | EUR | 194.459,09 | 0,02 |
| 200.000 | CNP ASSURANCES 30/06/2051 FRN EMTN | EUR | 214.815,00 | 0,02 |
| 600.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.875% 06/05/2034 EMTN | EUR | 640.293,94 | 0,07 |
| 300.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.250% 24/03/2031 EMTN | EUR | 331.621,56 | 0,04 |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.375% 03/02/2032 EMTN | EUR | 224.033,05 | 0,02 |
| 300.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.500% 03/02/2037 EMTN | EUR | 347.525,52 | 0,04 |
| 800.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 1.500% 28/09/2038 EMTN | EUR | 933.671,25 | 0,10 |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE SA 0.875% 14/01/2032 EMTN | EUR | 201.797,27 | 0,02 |
| 2.300.000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA 2.000% 09/12/2049 EMTN | EUR | 2.444.837,81 | 0,27 |
| 700.000 | ENGIE SA 1.500% 13/03/2035 EMTN | EUR | 754.768,24 | 0,08 |
| 3.751.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2040 | EUR | 3.671.111,35 | 0,40 |
| 529.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2072 | EUR | 408.164,29 | 0,04 |
| 1.300.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/06/2044 | EUR | 1.241.172,66 | 0,14 |
| 8.700.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.750% 25/05/2052 | EUR | 8.286.921,74 | 0,90 |
| 9.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.250% 25/05/2034 | EUR | 10.031.440,41 | 1,09 |
| 9.693.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.250% 25/05/2036 | EUR | 10.817.612,59 | 1,18 |
| 6.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.500% 25/05/2031 | EUR | 6.818.968,80 | 0,74 |
| 16.850.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.500% 25/05/2050 | EUR | 19.522.288,01 | 2,14 |
| 9.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/05/2066 | EUR | 11.308.593,51 | 1,23 |
| 5.598.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/06/2039 | EUR | 6.779.263,26 | 0,74 |
| 37.175.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.000% 25/05/2048 | EUR | 47.741.157,31 | 5,21 |
| 7.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.250% 25/05/2045 | EUR | 10.874.752,91 | 1,19 |
| 5.600.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/04/2055 | EUR | 10.544.570,23 | 1,15 |
| 904.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/04/2060 | EUR | 1.778.857,83 | 0,19 |
| 8.398.265 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.000% 25/10/2038 | EUR | 13.243.045,20 | 1,44 |
| 10.500.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.500% 25/04/2041 | EUR | 18.092.169,48 | 1,97 |
| 7.660.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 4.750% 25/04/2035 | EUR | 12.180.109,85 | 1,33 |
| 11.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 5.750% 25/10/2032 | EUR | 17.768.287,57 | 1,94 |
| 400.000 | GECINA SA 0.875% 30/06/2036 EMTN | EUR | 400.584,91 | 0,04 |
| 300.000 | GECINA SA 2.000% 30/06/2032 EMTN | EUR | 346.034,30 | 0,04 |
| 100.000 | KLEPIERRE SA 1.625% 13/12/2032 EMTN | EUR | 107.651,09 | 0,01 |
| 900.000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.375% 11/02/2031 | EUR | 910.376,12 | 0,10 |
| 300.000 | MUTUELLE ASSURANCE DES COMMERCANTS ET INDUSTRIELS DE FRANCE ET DES CADRES ET SAL 21/06/2052 FRN | EUR | 301.866,88 | 0,03 |
| 400.000 | ORANGE SA 1.375% 04/09/2049 EMTN | EUR | 405.842,18 | 0,04 |
| 300.000 | ORANGE SA 1.375% 16/01/2030 EMTN | EUR | 325.193,94 | 0,04 |
| 200.000 | RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 1.875% 23/10/2037 EMTN | EUR | 227.479,52 | 0,02 |
| 1.400.000 | RTE RESEAU DE TRANSPORT D'ELECTRICITE SADIR 2.000% 18/04/2036 EMTN | EUR | 1.612.772,84 | 0,18 |
| 100.000 | SANOFI 1.875% 21/03/2038 EMTN | EUR | 119.303,83 | 0,01 |
| 3.500.000 | SNCF RESEAU 3.300% 18/12/2042 EMTN | EUR | 5.054.423,85 | 0,55 |
| 5.480.000 | SNCF RESEAU 5.000% 10/10/2033 EMTN | EUR | 8.348.505,56 | 0,91 |
| 2.500.000 | TOTALENERGIES CAPITAL INTERNATIONAL SA 1.535% 31/05/2039 EMTN | EUR | 2.722.009,83 | 0,30 |
| 500.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 488.809,74 | 0,05 |
| 300.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.375% 04/12/2031 EMTN | EUR | 311.306,96 | 0,03 |
| 200.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.750% 01/07/2049 EMTN | EUR | 193.990,31 | 0,02 |
| 900.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 2.250% 14/05/2038 EMTN | EUR | 994.733,33 | 0,11 |
| | | | **245.819.105,70** | **26,79** |
| **Italien** | | | | |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 1.000% 30/09/2031 EMTN | EUR | 215.784,55 | 0,02 |
| 300.000 | CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 1.750% 15/01/2038 EMTN | EUR | 358.131,61 | 0,04 |
| 320.000 | ITALGAS SPA 1.000% 11/12/2031 EMTN | EUR | 325.965,08 | 0,04 |
| 1.241.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.500% 30/04/2045 | EUR | 1.208.190,11 | 0,13 |
| 5.400.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.650% 01/03/2032 | EUR | 5.794.603,92 | 0,63 |
| 3.252.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.700% 01/09/2051 | EUR | 3.172.451,10 | 0,35 |
| 1.795.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.800% 01/03/2041 | EUR | 1.873.635,75 | 0,20 |
| 3.194.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.250% 01/09/2036 | EUR | 3.626.120,54 | 0,40 |
| 5.007.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.450% 01/09/2033 | EUR | 5.781.828,29 | 0,63 |
| 6.000.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.450% 01/09/2050 | EUR | 6.887.316,06 | 0,75 |
| 5.536.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.700% 01/03/2047 | EUR | 6.652.446,28 | 0,73 |
| 3.660.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.800% 01/03/2067 | EUR | 4.310.202,00 | 0,47 |
| 3.839.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.950% 01/09/2038 | EUR | 4.743.285,05 | 0,52 |
| 2.626.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.100% 01/03/2040 | EUR | 3.311.474,10 | 0,36 |
| 4.772.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.250% 01/09/2046 | EUR | 6.274.551,91 | 0,68 |
| 4.500.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.350% 01/03/2035 | EUR | 5.712.867,77 | 0,62 |
| 4.161.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.450% 01/03/2048 | EUR | 5.669.437,94 | 0,62 |
| 1.950.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.850% 01/09/2049 | EUR | 2.845.772,01 | 0,31 |
| 8.438.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.000% 01/02/2037 | EUR | 11.580.169,53 | 1,26 |
| 4.309.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.750% 01/09/2044 | EUR | 6.879.466,95 | 0,75 |
| 11.224.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.000% 01/08/2034 | EUR | 16.425.663,24 | 1,78 |
| 7.122.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.000% 01/08/2039 | EUR | 11.124.099,79 | 1,21 |
| 5.786.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.000% 01/09/2040 | EUR | 9.142.769,13 | 1,00 |
| 8.480.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.750% 01/02/2033 | EUR | 12.824.343,26 | 1,40 |
| | | | **136.740.575,97** | **14,90** |
| **Spanien** | | | | |
| 700.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 3.000% 27/03/2031 EMTN | EUR | 816.614,89 | 0,09 |
| 300.000 | BANCO SANTANDER SA 0.875% 09/05/2031 EMTN | EUR | 320.451,38 | 0,03 |
| 200.000 | BANCO SANTANDER SA 2.000% 27/11/2034 | EUR | 241.716,54 | 0,03 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Long Duration Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.000.000 | CAIXABANK SA 4.125% 24/03/2036 | EUR | 1.516.785,68 | 0,17 |
| 100.000 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 1.875% 04/12/2034 | EUR | 99.741,20 | 0,01 |
| 1.200.000 | PROGRAMA CEDULAS TDA FONDO DE TITULIZACION DE ACTIVOS 4.250% 10/04/2031 | EUR | 1.655.228,95 | 0,18 |
| 2.867.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 0.850% 30/07/2037 | EUR | 2.842.968,98 | 0,31 |
| 5.000.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.000% 31/10/2050 | EUR | 4.596.604,40 | 0,50 |
| 6.500.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.200% 31/10/2040 | EUR | 6.681.008,69 | 0,73 |
| 2.500.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.450% 31/10/2071 | EUR | 2.224.036,08 | 0,24 |
| 6.383.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.850% 30/07/2035 | EUR | 7.320.843,34 | 0,80 |
| 4.000.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 2.700% 31/10/2048 | EUR | 5.325.239,36 | 0,58 |
| 6.200.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 2.900% 31/10/2046 | EUR | 8.491.338,22 | 0,93 |
| 3.750.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 3.450% 30/07/2066 | EUR | 5.758.790,96 | 0,63 |
| 6.448.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 4.200% 31/01/2037 | EUR | 9.655.605,51 | 1,05 |
| 5.530.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 4.700% 30/07/2041 | EUR | 9.212.845,84 | 1,00 |
| 6.211.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 4.900% 30/07/2040 | EUR | 10.483.715,16 | 1,14 |
| 4.688.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 5.150% 31/10/2044 | EUR | 8.551.390,79 | 0,93 |
| 13.250.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 5.750% 30/07/2032 | EUR | 20.677.745,69 | 2,25 |
| 1.400.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.957% 01/07/2039 | EUR | 1.536.954,61 | 0,17 |
| | | | **108.009.626,27** | **11,77** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 200.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031 | EUR | 201.550,15 | 0,02 |
| 500.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 1.350% 18/09/2039 | EUR | 503.371,99 | 0,05 |
| 1.300.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 1.800% 18/09/2049 | EUR | 1.370.036,15 | 0,15 |
| 2.290.000 | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 1.200% 17/02/2045 EMTN | EUR | 2.590.872,45 | 0,28 |
| 1.122.000 | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 1.375% 31/05/2047 EMTN | EUR | 1.323.210,03 | 0,14 |
| 6.645.000 | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 1.450% 05/09/2040 EMTN | EUR | 7.766.957,95 | 0,85 |
| 8.005.000 | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 1.700% 13/02/2043 EMTN | EUR | 9.832.102,75 | 1,08 |
| 5.595.000 | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 2.000% 28/02/2056 EMTN | EUR | 7.876.280,51 | 0,86 |
| 11.400.000 | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 2.350% 29/07/2044 EMTN | EUR | 15.751.190,53 | 1,73 |
| 5.000.000 | EUROPEAN FINANCIAL STABILITY FACILITY 3.375% 03/04/2037 EMTN | EUR | 7.252.026,15 | 0,79 |
| 228.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.625% 19/01/2033 EMTN | EUR | 218.501,20 | 0,02 |
| 106.000 | JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN | EUR | 124.537,40 | 0,01 |
| 1.800.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.500% 02/07/2039 | EUR | 1.876.744,98 | 0,20 |
| 600.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.750% 02/07/2049 | EUR | 631.142,17 | 0,07 |
| 128.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN | EUR | 137.340,18 | 0,01 |
| 300.000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN | EUR | 302.314,09 | 0,03 |
| | | | **57.758.178,68** | **6,29** |
| | **Niederlande** | | | |
| 1.000.000 | ABN AMRO BANK NV 1.000% 13/04/2031 EMTN | EUR | 1.083.135,52 | 0,12 |
| 400.000 | ABN AMRO BANK NV 1.125% 12/01/2032 | EUR | 438.256,84 | 0,05 |
| 700.000 | ABN AMRO BANK NV 1.125% 23/04/2039 | EUR | 774.939,51 | 0,08 |
| 300.000 | ABN AMRO BANK NV 1.250% 10/01/2033 EMTN | EUR | 333.435,55 | 0,04 |
| 1.100.000 | ABN AMRO BANK NV 1.375% 12/01/2037 | EUR | 1.252.119,46 | 0,14 |
| 200.000 | ABN AMRO BANK NV 1.450% 12/04/2038 | EUR | 231.264,37 | 0,03 |
| 100.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 2.000% 17/09/2030 | EUR | 113.444,34 | 0,01 |
| 300.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.010% 27/11/2040 EMTN | EUR | 271.402,74 | 0,03 |
| 500.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 0.750% 21/06/2039 | EUR | 521.593,86 | 0,06 |
| 200.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 1.250% 31/05/2032 EMTN | EUR | 221.631,16 | 0,02 |
| 400.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 1.500% 26/04/2038 EMTN | EUR | 465.708,20 | 0,05 |
| 400.000 | DE VOLKSBANK NV 0.125% 19/11/2040 EMTN | EUR | 371.113,74 | 0,04 |
| 750.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 7.500% 24/01/2033 EMTN | EUR | 1.292.955,81 | 0,14 |
| 145.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032 | EUR | 142.118,95 | 0,02 |
| 300.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.250% 01/02/2031 | EUR | 304.840,38 | 0,03 |
| 300.000 | DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031 | EUR | 286.939,98 | 0,03 |
| 700.000 | ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 1.875% 31/10/2033 EMTN | EUR | 799.606,82 | 0,09 |
| 388.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 28/09/2034 EMTN | EUR | 384.051,26 | 0,04 |
| 125.000 | ENEXIS HOLDING NV 0.750% 02/07/2031 EMTN | EUR | 129.157,68 | 0,01 |
| 1.100.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN | EUR | 1.677.660,09 | 0,18 |
| 100.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.625% 22/04/2032 | EUR | 109.832,57 | 0,01 |
| 300.000 | KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN | EUR | 303.308,32 | 0,03 |
| 461.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 1.625% 17/09/2031 | EUR | 497.117,43 | 0,05 |
| 1.553.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2038 | EUR | 1.499.926,71 | 0,16 |
| 2.532.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2052 | EUR | 2.273.966,51 | 0,25 |
| 3.026.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/01/2040 | EUR | 3.193.773,76 | 0,35 |
| 5.680.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.500% 15/01/2033 | EUR | 7.301.705,21 | 0,80 |
| 4.485.904 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.750% 15/01/2047 | EUR | 7.228.031,88 | 0,79 |
| 4.525.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.750% 15/01/2042 | EUR | 7.709.713,01 | 0,84 |
| 5.000.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.000% 15/01/2037 | EUR | 7.943.203,80 | 0,87 |
| 1.000.000 | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 11/11/2032 EMTN | EUR | 1.053.422,12 | 0,11 |
| 347.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 0.500% 05/09/2034 EMTN | EUR | 344.940,67 | 0,04 |
| 385.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.250% 28/02/2031 | EUR | 419.510,92 | 0,05 |
| 238.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 1.375% 06/09/2030 EMTN | EUR | 261.132,19 | 0,03 |
| 1.500.000 | TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN | EUR | 1.621.437,27 | 0,18 |
| 1.270.000 | TENNET HOLDING BV 1.875% 13/06/2036 EMTN | EUR | 1.448.997,83 | 0,16 |
| 300.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 3.300% 22/03/2033 EMTN | EUR | 372.826,51 | 0,04 |
| 1.000.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 4.125% 16/11/2038 | EUR | 1.381.265,55 | 0,15 |
| 400.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.125% 14/09/2034 EMTN | EUR | 397.792,19 | 0,04 |
| 300.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.625% 07/10/2039 EMTN | EUR | 303.618,42 | 0,03 |
| | | | **56.760.899,13** | **6,19** |
| | **Belgien** | | | |
| 1.900.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN | EUR | 2.272.503,55 | 0,25 |
| 2.000.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.400% 22/06/2040 | EUR | 1.921.079,38 | 0,21 |
| 1.600.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 0.650% 22/06/2071 | EUR | 1.328.090,50 | 0,14 |
| 5.200.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.250% 22/04/2033 | EUR | 5.845.823,83 | 0,65 |
| 1.184.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.450% 22/06/2037 | EUR | 1.361.678,78 | 0,15 |
| 3.800.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.600% 22/06/2047 | EUR | 4.471.987,52 | 0,49 |
| 2.171.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.700% 22/06/2050 | EUR | 2.612.835,23 | 0,28 |
| 2.382.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.900% 22/06/2038 | EUR | 2.914.456,99 | 0,32 |
| 1.667.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.150% 22/06/2066 | EUR | 2.329.706,00 | 0,25 |
| 1.816.699 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.250% 22/06/2057 | EUR | 2.518.822,04 | 0,27 |
| 1.631.882 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.000% 22/06/2034 | EUR | 2.188.901,99 | 0,24 |
| 3.246.379 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 3.750% 22/06/2045 | EUR | 5.362.157,33 | 0,58 |
| 2.099.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.000% 28/03/2032 | EUR | 2.958.275,98 | 0,32 |
| 4.571.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 4.250% 28/03/2041 | EUR | 7.620.452,24 | 0,83 |
| 5.504.947 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.000% 28/03/2035 | EUR | 8.938.573,69 | 0,98 |
| | | | **54.645.345,05** | **5,96** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Long Duration Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Deutschland** | | | |
| 4.320.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/05/2035 | EUR | 4.323.153,60 | 0,47 |
| 2.500.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2050 | EUR | 2.309.732,28 | 0,25 |
| 8.260.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.000% 04/01/2037 | EUR | 13.369.057,80 | 1,46 |
| 4.897.568 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.250% 04/07/2039 | EUR | 8.580.643,06 | 0,94 |
| 2.760.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.750% 04/07/2034 | EUR | 4.508.893,62 | 0,49 |
| 3.400.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.750% 04/07/2040 | EUR | 6.402.783,07 | 0,70 |
| 767.000 | DAIMLER AG 0.750% 11/03/2033 EMTN | EUR | 769.703,39 | 0,08 |
| 400.000 | DZ HYP AG 0.375% 10/11/2034 EMTN | EUR | 401.679,82 | 0,04 |
| 600.000 | HANNOVER RUECK SE 08/10/2040 FRN | EUR | 626.875,66 | 0,07 |
| 300.000 | HANNOVER RUECK SE 30/06/2042 FRN | EUR | 301.006,89 | 0,03 |
| 300.000 | ING-DIBA AG 1.250% 09/10/2033 EMTN | EUR | 335.120,00 | 0,04 |
| 900.000 | MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.875% 05/07/2031 EMTN | EUR | 939.483,72 | 0,10 |
| 720.000 | STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY ZCP 12/10/2035 | EUR | 680.494,14 | 0,07 |
| 6.081.000 | STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 1.000% 16/10/2046 EMTN | EUR | 6.630.456,60 | 0,72 |
| 1.400.000 | STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 1.375% 15/01/2120 EMTN | EUR | 1.519.243,12 | 0,17 |
| 1.300.000 | STATE OF NORTH RHINE-WESTPHALIA GERMANY 1.750% 11/07/2068 | EUR | 1.702.169,40 | 0,19 |
| 145.000 | UNICREDIT BANK AG 0.250% 15/01/2032 | EUR | 146.111,29 | 0,02 |
| 200.000 | VONOVIA SE 0.750% 01/09/2032 EMTN | EUR | 194.955,54 | 0,02 |
| 400.000 | VONOVIA SE 1.500% 14/06/2041 | EUR | 395.629,05 | 0,04 |
| 300.000 | VONOVIA SE 1.625% 01/09/2051 EMTN | EUR | 280.474,28 | 0,03 |
| | | | **54.417.666,33** | **5,93** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 10.000.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.050% 27/01/2051 | EUR | 8.516.757,30 | 0,93 |
| 2.459.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.875% 13/09/2047 EMTN | EUR | 2.632.416,20 | 0,29 |
| 5.546.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.750% 15/09/2045 EMTN | EUR | 6.982.857,51 | 0,76 |
| 2.600.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 3.000% 14/10/2033 EMTN | EUR | 3.462.091,33 | 0,38 |
| 5.700.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 4.000% 15/10/2037 | EUR | 8.926.123,68 | 0,97 |
| 1.500.000 | EUROPEAN STABILITY MECHANISM 0.875% 18/07/2042 EMTN | EUR | 1.601.401,07 | 0,17 |
| 643.000 | EUROPEAN STABILITY MECHANISM 1.850% 01/12/2055 EMTN | EUR | 885.306,68 | 0,10 |
| 2.000.000 | EUROPEAN UNION 0.300% 04/11/2050 | EUR | 1.852.430,68 | 0,20 |
| | | | **34.859.384,45** | **3,80** |
| | **Österreich** | | | |
| 665.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/10/2040 | EUR | 606.029,11 | 0,07 |
| 438.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.700% 20/04/2071 | EUR | 414.295,27 | 0,05 |
| 1.611.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.750% 20/03/2051 | EUR | 1.659.395,63 | 0,18 |
| 950.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 0.850% 30/06/2020 | EUR | 847.279,83 | 0,09 |
| 830.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.500% 02/11/2086 | EUR | 1.064.370,14 | 0,12 |
| 2.166.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.500% 20/02/2047 | EUR | 2.647.101,00 | 0,29 |
| 1.689.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.100% 20/09/2117 | EUR | 2.719.208,08 | 0,30 |
| 1.504.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.400% 23/05/2034 | EUR | 1.921.722,86 | 0,21 |
| 2.355.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.150% 20/06/2044 | EUR | 3.720.498,17 | 0,40 |
| 717.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 3.800% 26/01/2062 | EUR | 1.484.150,29 | 0,16 |
| 3.957.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 4.150% 15/03/2037 | EUR | 6.285.811,86 | 0,68 |
| 300.000 | UNICREDIT BANK AUSTRIA AG 0.050% 21/09/2035 | EUR | 286.015,10 | 0,03 |
| 200.000 | VERBUND AG 0.900% 01/04/2041 | EUR | 201.054,42 | 0,02 |
| | | | **23.856.931,76** | **2,60** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 2.000.000 | AT&T INC 3.150% 04/09/2036 | EUR | 2.428.439,02 | 0,27 |
| 700.000 | AT&T INC 3.375% 15/03/2034 | EUR | 867.803,29 | 0,09 |
| 520.000 | CHUBB INA HOLDINGS INC 2.500% 15/03/2038 | EUR | 622.341,29 | 0,07 |
| 3.000.000 | COCA-COLA CO/THE 1.625% 09/03/2035 | EUR | 3.287.788,26 | 0,37 |
| 400.000 | ELI LILLY & CO 2.125% 03/06/2030 | EUR | 459.776,25 | 0,05 |
| 355.000 | EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033 | EUR | 352.852,07 | 0,04 |
| 490.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.000% 18/03/2033 EMTN | EUR | 490.994,62 | 0,05 |
| 1.073.000 | JPMORGAN CHASE & CO 04/11/2032 FRN EMTN | EUR | 1.102.885,04 | 0,12 |
| 400.000 | PEPSICO INC 0.875% 16/10/2039 | EUR | 394.421,36 | 0,04 |
| 600.000 | PROCTER & GAMBLE CO 1.875% 30/10/2038 | EUR | 707.222,09 | 0,08 |
| 300.000 | PROLOGIS EURO FINANCE LLC 1.500% 10/09/2049 | EUR | 293.894,45 | 0,03 |
| 500.000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.500% 01/10/2039 EMTN | EUR | 512.562,20 | 0,06 |
| 253.000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 2.875% 24/07/2037 | EUR | 311.016,59 | 0,03 |
| 389.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035 | EUR | 385.676,65 | 0,04 |
| 300.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.850% 18/05/2040 | EUR | 319.719,92 | 0,03 |
| 300.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.875% 15/01/2038 | EUR | 366.604,43 | 0,04 |
| 300.000 | WELLS FARGO & CO 0.625% 14/08/2030 | EUR | 297.281,32 | 0,03 |
| | | | **13.201.278,85** | **1,44** |
| | **Irland** | | | |
| 500.000 | GE CAPITAL EUROPEAN FUNDING UNLIMITED CO 6.025% 01/03/2038 EMTN | EUR | 825.043,89 | 0,09 |
| 1.156.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 0.400% 15/05/2035 | EUR | 1.154.787,12 | 0,13 |
| 2.044.464 | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.300% 15/05/2033 | EUR | 2.290.957,40 | 0,25 |
| 2.300.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.500% 15/05/2050 | EUR | 2.648.351,33 | 0,29 |
| 1.721.612 | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.700% 15/05/2037 | EUR | 2.035.069,24 | 0,22 |
| 3.163.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 2.000% 18/02/2045 | EUR | 4.034.293,55 | 0,44 |
| 100.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033 | EUR | 99.450,14 | 0,01 |
| | | | **13.087.952,67** | **1,43** |
| | **Finnland** | | | |
| 1.045.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15/04/2036 | EUR | 1.019.216,53 | 0,11 |
| 1.200.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15/04/2052 | EUR | 1.051.526,45 | 0,11 |
| 1.360.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 0.750% 15/04/2031 | EUR | 1.462.343,14 | 0,16 |
| 848.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 1.125% 15/04/2034 | EUR | 948.065,42 | 0,10 |
| 1.142.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 1.375% 15/04/2047 | EUR | 1.391.944,62 | 0,15 |
| 1.532.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 2.625% 04/07/2042 | EUR | 2.214.255,93 | 0,25 |
| 581.000 | SAMPO OYJ 03/09/2052 FRN EMTN | EUR | 617.398,11 | 0,07 |
| | | | **8.704.750,20** | **0,95** |
| | **Polen** | | | |
| 4.500.000 | POLAND GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.000% 25/10/2046 EMTN | EUR | 5.585.676,57 | 0,61 |
| | | | **5.585.676,57** | **0,61** |
| | **Rumänien** | | | |
| 4.000.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.625% 03/04/2049 EMTN | EUR | 4.690.921,64 | 0,51 |
| | | | **4.690.921,64** | **0,51** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Long Duration Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Slowenien** | | | |
| 1.087.000 | SLOVENIA GOVERNMENT BOND 1.500% 25/03/2035 | EUR | 1.230.772,90 | 0,13 |
| 1.770.000 | SLOVENIA GOVERNMENT BOND 1.750% 03/11/2040 | EUR | 2.111.125,27 | 0,23 |
| | | | **3.341.898,17** | **0,36** |
| | **Slowakei** | | | |
| 1.482.000 | SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 1.875% 09/03/2037 | EUR | 1.786.634,36 | 0,19 |
| 840.000 | SLOVAKIA GOVERNMENT BOND 2.000% 17/10/2047 | EUR | 1.063.010,65 | 0,12 |
| | | | **2.849.645,01** | **0,31** |
| | **Norwegen** | | | |
| 2.000.000 | EQUINOR ASA 1.625% 17/02/2035 EMTN | EUR | 2.183.757,86 | 0,24 |
| | | | **2.183.757,86** | **0,24** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.000.000 | BP CAPITAL MARKETS PLC 1.231% 08/05/2031 EMTN | EUR | 1.043.238,56 | 0,12 |
| 180.000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 1.375% 29/06/2032 EMTN | EUR | 201.341,51 | 0,02 |
| 400.000 | SWISS RE FINANCE UK PLC 04/06/2052 FRN EMTN | EUR | 437.484,20 | 0,05 |
| 200.000 | VODAFONE GROUP PLC 1.600% 29/07/2031 EMTN | EUR | 215.719,89 | 0,02 |
| | | | **1.897.784,16** | **0,21** |
| | **Japan** | | | |
| 500.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.375% 09/07/2032 | EUR | 522.656,39 | 0,06 |
| 1.000.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030 | EUR | 1.196.214,65 | 0,13 |
| | | | **1.718.871,04** | **0,19** |
| | **Jersey** | | | |
| 1.000.000 | HEATHROW FUNDING LTD 1.500% 11/02/2030 EMTN | EUR | 1.032.959,07 | 0,11 |
| | | | **1.032.959,07** | **0,11** |
| | **Portugal** | | | |
| 1.000.000 | PORTUGAL OBRIGACOES DO TESOURO OT 1.000% 12/04/2052 | EUR | 927.091,68 | 0,10 |
| | | | **927.091,68** | **0,10** |
| | **Australien** | | | |
| 800.000 | BHP BILLITON FINANCE LTD 1.500% 29/04/2030 | EUR | 860.076,43 | 0,09 |
| | | | **860.076,43** | **0,09** |
| | **Schweiz** | | | |
| 373.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 0.625% 18/01/2033 EMTN | EUR | 351.379,29 | 0,04 |
| 500.000 | UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN | EUR | 495.768,74 | 0,05 |
| | | | **847.148,03** | **0,09** |
| | **Schweden** | | | |
| 500.000 | SVERIGES SAKERSTALLDA OBLIGATIONER AB 1.250% 19/04/2033 EMTN | EUR | 553.840,55 | 0,06 |
| | | | **553.840,55** | **0,06** |
| | | | **834.351.365,27** | **90,93** |

### Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Offene Fonds

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Luxemburg** | | | |
| 3.548 | NN (L) EUROPEAN ABS - Z CAP EUR | EUR | 19.407.453,56 | 2,12 |
| 56.681 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 56.154.002,43 | 6,12 |
| | | | **75.561.455,99** | **8,24** |
| | | | **75.561.455,99** | **8,24** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **909.912.821,26** | **99,17** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swaps** | | | | | | |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 35 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2026 | EUR | 32.283.000,00 | 842.967,56 |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 35 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/06/2026 | EUR | 32.283.000,00 | 842.002,30 |
| | | | | | | **1.684.969,86** |

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| **Zinsswaps** | | | | | |
| Floating | 0,078 | 15/04/2031 | EUR | 35.266.000,00 | 201.550,13 |
| -0.275 | Floating | 22/08/2029 | EUR | 9.854.000,00 | (230.517,07) |
| 0.075 | Floating | 02/02/2041 | EUR | 17.259.000,00 | (1.380.482,17) |
| | | | | | **(1.409.449,11)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| 5 | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 674.650,00 | (4.000,00) |
| 488 | EURO-BTP FUTURE 08/12/2021 | EUR | 74.151.600,00 | (1.102.335,74) |
| 831 | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 141.120.420,00 | (444.145,50) |
| 35 | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 7.116.900,00 | (253.400,00) |
| (727) | EURO-OAT FUTURE 08/12/2021 | EUR | 120.645.650,00 | 1.187.049,15 |
| (3) | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 336.615,00 | 255,00 |
| | | | **344.045.835,00** | **(616.577,09)** |
| | **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | **(341.056,34)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Long Duration Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **909.912.821,26** | **99,17** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(341.056,34)** | **(0,04)** |
| **Bankguthaben** | **99.778,19** | **0,01** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **7.871.866,74** | **0,86** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **917.543.409,85** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Short Duration

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 164.829.097,50 |
| | 30.09.2020 | EUR | 194.624.193,16 |
| | 30.09.2019 | EUR | 234.576.142,06 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.343,79 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.375,20 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.396,63 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 429,78 |
| | 30.09.2020 | EUR | 433,60 |
| | 30.09.2019 | EUR | 436,67 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 433,51 |
| | 30.09.2020 | EUR | 436,37 |
| | 30.09.2019 | EUR | 438,41 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.020,61 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.031,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.033,86 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.209,15 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.220,02 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.228,64 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.219,82 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.227,82 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.233,54 |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 250.920,61 |
| | 30.09.2020 | EUR | 251.486,95 |
| | 30.09.2019 | EUR | 251.572,96 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 18.850 |
| | 30.09.2020 | | 20.269 |
| | 30.09.2019 | | 9.154 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 6.576 |
| | 30.09.2020 | | 19.888 |
| | 30.09.2019 | | 17.968 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 407 |
| | 30.09.2020 | | 407 |
| | 30.09.2019 | | 407 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 9.513 |
| | 30.09.2020 | | 11.842 |
| | 30.09.2019 | | 4.856 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 474 |
| | 30.09.2020 | | 574 |
| | 30.09.2019 | | 733 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 62 |
| | 30.09.2020 | 78 |
| | 30.09.2019 | 78 |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | 51 |
| | 30.09.2020 | 66 |
| | 30.09.2019 | 603 |
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,80% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,13% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 0,80% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,13% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 142,78% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Short Duration

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **165.472.023,11** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 152.015.134,96 |
| Geldmarktinstrumente | | 13.456.888,15 |
| **Bankguthaben** | | **2.740.991,23** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **73.394,18** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **2.592.252,38** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***170.878.660,90*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(6.026.643,40)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(22.920,00)** |
| Futures | | (22.920,00) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(6.049.563,40)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***164.829.097,50*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.069.304,99)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (430.391,49) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (217.605,45) |
| Abonnementsteuer | 9 | (20.711,24) |
| Bankzinsen | | (9.671,39) |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | (390.925,42) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(1.069.304,99)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 635.719,12 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (7.747,43) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 101.140,00 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (82.789,86) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (347.762,70) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (48.660,00) |
| **Ergebnis** | | **(819.405,86)** |
| Zeichnungen | | 23.322.739,30 |
| Rücknahmen | | (52.298.429,10) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 194.624.193,16 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***164.829.097,50*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Short Duration

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Italien** | | | |
| 26.500.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO ZCP 29/11/2022 | EUR | 26.630.536,62 | 16,15 |
| 12.000.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO ZCP 30/01/2024 | EUR | 12.075.836,16 | 7,33 |
| 2.400.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.750% 01/07/2024 | EUR | 2.530.819,78 | 1,54 |
| 3.500.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.750% 01/09/2024 | EUR | 3.905.060,88 | 2,37 |
| 11.000.000 | ITALY CERTIFICATI DI CREDITO DEL TESORO ZCP 30/05/2022 | EUR | 11.035.200,77 | 6,69 |
| | | | **56.177.454,21** | **34,08** |
| | **Spanien** | | | |
| 100.893 | DRIVER ESPANA FIVE FDT -5 A 21/12/2028 FRN | EUR | 100.930,00 | 0,06 |
| 20.000.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND ZCP 31/05/2024 | EUR | 20.247.600,80 | 12,29 |
| | | | **20.348.530,80** | **12,35** |
| | **Deutschland** | | | |
| 6.000.000 | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN ZCP 16/06/2023 | EUR | 6.071.750,28 | 3,68 |
| 7.000.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 2.375% 06/09/2022 EMTN | EUR | 7.174.076,91 | 4,36 |
| | | | **13.245.827,19** | **8,04** |
| | **Irland** | | | |
| 5.000.000 | GERMAN POSTAL PENSIONS SECURITISATION 2 PLC 4.375% 18/01/2022 | EUR | 5.071.498,35 | 3,08 |
| 4.000.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 3.400% 18/03/2024 | EUR | 4.396.247,84 | 2,67 |
| 3.200.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 3.900% 20/03/2023 | EUR | 3.414.464,29 | 2,07 |
| | | | **12.882.210,48** | **7,82** |
| | **Dänemark** | | | |
| 6.000.000 | DANSKE BANK AS 0.250% 28/11/2022 EMTN | EUR | 6.046.131,24 | 3,68 |
| 3.000.000 | NYKREDIT REALKREDIT AS 0.500% 19/01/2022 EMTN | EUR | 3.007.334,07 | 1,82 |
| 2.850.000 | NYKREDIT REALKREDIT AS 31/10/2031 FRN | EUR | 2.890.823,57 | 1,75 |
| | | | **11.944.288,88** | **7,25** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 3.000.000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 0.125% 03/12/2022 | EUR | 3.013.272,90 | 1,83 |
| 4.500.000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 0.750% 21/05/2023 | EUR | 4.566.864,78 | 2,77 |
| 3.627.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 26/07/2022 EMTN | EUR | 3.679.949,70 | 2,23 |
| | | | **11.260.087,38** | **6,83** |
| | **Guernsey** | | | |
| 7.870.000 | CREDIT SUISSE GROUP FUNDING GUERNSEY LTD 1.250% 14/04/2022 EMTN | EUR | 7.931.878,11 | 4,81 |
| | | | **7.931.878,11** | **4,81** |
| | **Frankreich** | | | |
| 3.000.000 | DEXIA CREDIT LOCAL SA 0.625% 03/02/2024 EMTN | EUR | 3.071.839,47 | 1,86 |
| 3.500.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/02/2024 | EUR | 3.552.604,62 | 2,16 |
| | | | **6.624.444,09** | **4,02** |
| | **Kanada** | | | |
| 5.500.000 | TORONTO-DOMINION BANK/THE 0.375% 25/04/2024 EMTN | EUR | 5.576.393,46 | 3,38 |
| | | | **5.576.393,46** | **3,38** |
| | **Niederlande** | | | |
| 2.417.000 | BMW FINANCE NV 0.625% 06/10/2023 EMTN | EUR | 2.461.946,92 | 1,49 |
| 1.200.000 | ING GROEP NV 0.750% 09/03/2022 EMTN | EUR | 1.206.370,91 | 0,73 |
| | | | **3.668.317,83** | **2,22** |
| | **Australien** | | | |
| 1.350.000 | ORIGIN ENERGY FINANCE LTD 3.500% 04/10/2021 | EUR | 1.350.000,00 | 0,82 |
| | | | **1.350.000,00** | **0,82** |
| | | | **151.009.432,43** | **91,62** |
| **Geldmarktinstrumente** | | | | |
| | **Deutschland** | | | |
| 9.000.000 | GERMAN TREASURY BILL ZCP 22/06/2022 | EUR | 9.045.493,56 | 5,49 |
| | | | **9.045.493,56** | **5,49** |
| | **Spanien** | | | |
| 4.400.000 | SPAIN LETRAS DEL TESORO ZCP 04/03/2022 | EUR | 4.411.394,59 | 2,67 |
| | | | **4.411.394,59** | **2,67** |
| | | | **13.456.888,15** | **8,16** |
| **Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Frankreich** | | | |
| 1.000.000 | CENTRE HSPTL NANCY ZCP 24/10/2022 | EUR | 1.005.702,53 | 0,61 |
| | | | **1.005.702,53** | **0,61** |
| | | | **1.005.702,53** | **0,61** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **165.472.023,11** | **100,39** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Future** | | | | |
| 191 | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 21.431.155,00 | (22.920,00) |
| | | | **21.431.155,00** | **(22.920,00)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(22.920,00)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Short Duration

*(ausgedrückt in EUR)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **165.472.023,11** | **100,39** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(22.920,00)** | **(0,01)** |
| **Bankguthaben** | **2.740.991,23** | **1,66** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(3.360.996,84)** | **(2,04)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **164.829.097,50** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 1.180.733.751,17 |
| | 30.09.2020 | EUR | 971.708.644,25 |
| | 30.09.2019 | EUR | 968.143.375,05 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.820,73 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.721,40 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.692,02 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 27,13 |
| | 30.09.2020 | EUR | 26,66 |
| | 30.09.2019 | EUR | 26,50 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 254,82 |
| | 30.09.2020 | EUR | 251,40 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation T (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.851,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.742,04 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.702,84 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 249,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.096,56 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.991,59 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 272,19 |
| | 30.09.2020 | EUR | 268,52 |
| | 30.09.2019 | EUR | 268,12 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 268,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 263,95 |
| | 30.09.2019 | EUR | 263,24 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 141.511 |
| | 30.09.2020 | | 134.006 |
| | 30.09.2019 | | 138.237 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 4.725.123 |
| | 30.09.2020 | | 2.065.578 |
| | 30.09.2019 | | 2.258.507 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 18.220 |
| | 30.09.2020 | | 2.667 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation T (EUR) | 30.09.2021 | | 27.893 |
| | 30.09.2020 | | 18.459 |
| | 30.09.2019 | | 20.485 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 8 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 7.930 |
| | 30.09.2020 | | 6.751 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 66.550 |
| | 30.09.2020 | | 28.979 |
| | 30.09.2019 | | 13.622 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | | 9.050 |
| | 30.09.2020 | | 6.832 |
| | 30.09.2019 | | 3.668 |
| **Dividende** | | | |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,25 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,49% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 0,43% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 0,85% |
| Capitalisation T (EUR) | 30.09.2021 | | 0,32% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 0,91% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,13% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 0,85% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | | 0,56% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 65,30% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Sustainable Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **1.155.687.492,49** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 1.155.687.492,49 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **557.873,36** |
| Credit Default Swaps | | 160.469,74 |
| Zinsswaps | | 71.999,09 |
| Futures | | 325.404,53 |
| **Bankguthaben** | | **33.114.621,51** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **371.613,38** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **14.880.418,92** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***1.204.612.019,66*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(23.870.985,50)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(7.282,99)** |
| Devisentermingeschäfte | | (7.282,99) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(23.878.268,49)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.180.733.751,17*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **11.507.945,86** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 11.445.526,60 |
| Zinsen auf Swaps | | 45.895,92 |
| Sonstige Erträge | 10 | 16.523,34 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(5.237.660,88)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (3.537.136,93) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.371.414,55) |
| Abonnementsteuer | 9 | (166.459,53) |
| Bankzinsen | | (107.943,16) |
| Zinsen auf Swaps | | (54.706,71) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **6.270.284,98** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 20.858.607,71 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.556.136,99) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 6.235.098,43 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (5.090.315,56) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 200.000,07 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (162.765,94) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (10.227.873,90) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 220.229,50 |
| **Ergebnis** | | **16.747.128,30** |
| Zeichnungen | | 400.935.202,93 |
| Rücknahmen | | (208.655.381,31) |
| Ausschüttung | | (1.843,00) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 971.708.644,25 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.180.733.751,17*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Anleihen und andere Schuldtitel

**Niederlande**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 900.000 | ABN AMRO BANK NV 0.500% 23/09/2029 EMTN | EUR | 892.453,00 | 0,08 |
| 1.947.000 | ADECCO INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV 0.125% 21/09/2028 EMTN | EUR | 1.913.765,76 | 0,16 |
| 2.354.000 | ADECCO INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV 0.500% 21/09/2031 EMTN | EUR | 2.312.449,00 | 0,20 |
| 2.982.000 | AGCO INTERNATIONAL HOLDINGS BV 0.800% 06/10/2028 | EUR | 2.996.978,02 | 0,25 |
| 561.000 | AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY FINANCING BV 1.125% 11/01/2029 EMTN | EUR | 571.981,71 | 0,05 |
| 2.700.000 | ALLIANDER NV FRN PERP | EUR | 2.805.640,34 | 0,24 |
| 700.000 | ALLIANDER NV 0.875% 22/04/2026 EMTN | EUR | 730.090,09 | 0,06 |
| 1.080.000 | ALLIANDER NV 2.875% 14/06/2024 EMTN | EUR | 1.173.120,16 | 0,10 |
| 2.300.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 1.125% 17/09/2025 | EUR | 2.403.156,68 | 0,20 |
| 2.000.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 01/10/2046 FRN EMTN | EUR | 2.277.472,12 | 0,19 |
| 1.300.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 19/02/2049 FRN | EUR | 1.453.716,47 | 0,12 |
| 1.355.000 | ASML HOLDING NV 0.250% 25/02/2030 | EUR | 1.347.151,24 | 0,11 |
| 5.070.000 | ATRADIUS FINANCE BV 23/09/2044 FRN | EUR | 5.659.341,31 | 0,48 |
| 2.040.000 | BMW FINANCE NV ZCP 24/03/2023 EMTN | EUR | 2.051.230,16 | 0,17 |
| 5.200.000 | BRENNTAG FINANCE BV 0.500% 06/10/2029 EMTN | EUR | 5.168.576,56 | 0,44 |
| 400.000 | CITYCON TREASURY BV 1.625% 12/03/2028 EMTN | EUR | 408.363,52 | 0,03 |
| 1.225.000 | CONTI-GUMMI FINANCE BV 1.125% 25/09/2024 | EUR | 1.263.901,79 | 0,11 |
| 180.000 | CRH FUNDING BV 1.875% 09/01/2024 EMTN | EUR | 187.655,87 | 0,02 |
| 700.000 | CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN | EUR | 709.017,27 | 0,06 |
| 3.147.000 | CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN | EUR | 3.158.037,44 | 0,27 |
| 1.600.000 | CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN | EUR | 1.583.172,00 | 0,13 |
| 951.000 | CTP NV 2.125% 01/10/2025 EMTN | EUR | 1.014.467,77 | 0,09 |
| 3.895.000 | DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN | EUR | 3.864.317,41 | 0,33 |
| 800.000 | DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN | EUR | 805.622,22 | 0,07 |
| 2.000.000 | DE VOLKSBANK NV 0.375% 03/03/2028 EMTN | EUR | 1.977.048,12 | 0,17 |
| 5.200.000 | DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN | EUR | 5.456.247,42 | 0,46 |
| 3.500.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.125% 22/05/2026 EMTN | EUR | 3.679.616,54 | 0,31 |
| 1.500.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.375% 30/01/2027 EMTN | EUR | 1.603.497,35 | 0,14 |
| 1.109.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 03/04/2028 EMTN | EUR | 1.202.229,78 | 0,10 |
| 1.600.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032 | EUR | 1.568.209,09 | 0,13 |
| 1.000.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.250% 01/02/2031 | EUR | 1.016.134,60 | 0,09 |
| 355.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030 | EUR | 372.887,43 | 0,03 |
| 1.183.000 | DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031 | EUR | 1.131.499,98 | 0,10 |
| 2.935.000 | ELM BV FOR FIRMENICH INTERNATIONAL SA FRN PERP | EUR | 3.155.315,01 | 0,27 |
| 4.530.000 | ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP | EUR | 4.864.087,50 | 0,41 |
| 6.988.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.500% 17/06/2030 EMTN | EUR | 6.957.842,10 | 0,60 |
| 2.574.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 17/06/2036 EMTN | EUR | 2.504.856,70 | 0,21 |
| 5.217.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 28/09/2034 EMTN | EUR | 5.163.905,70 | 0,44 |
| 2.400.000 | ENEXIS HOLDING NV 0.875% 28/04/2026 EMTN | EUR | 2.500.493,18 | 0,21 |
| 5.200.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN | EUR | 7.930.756,81 | 0,67 |
| 835.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.000% 22/04/2027 | EUR | 875.559,84 | 0,07 |
| 1.085.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.625% 22/04/2032 | EUR | 1.191.683,38 | 0,10 |
| 1.146.000 | HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.750% 06/09/2029 EMTN | EUR | 1.118.336,33 | 0,09 |
| 900.000 | HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.375% 03/03/2027 EMTN | EUR | 933.490,98 | 0,08 |
| 1.500.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 1.532.422,58 | 0,13 |
| 2.100.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 2.119.488,53 | 0,18 |
| 6.000.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 6.195.000,00 | 0,52 |
| 1.500.000 | ING GROEP NV 11/04/2028 FRN EMTN | EUR | 1.568.014,85 | 0,13 |
| 3.000.000 | ING GROEP NV 15/02/2029 FRN EMTN | EUR | 3.162.573,90 | 0,27 |
| 1.700.000 | ING GROEP NV 18/02/2029 FRN | EUR | 1.665.647,59 | 0,14 |
| 2.500.000 | ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN | EUR | 2.652.073,60 | 0,22 |
| 3.360.000 | KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN | EUR | 3.397.053,21 | 0,29 |
| 5.500.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 0.500% 22/05/2026 | EUR | 5.626.954,74 | 0,48 |
| 2.800.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 0.750% 02/05/2024 | EUR | 2.864.436,32 | 0,24 |
| 1.900.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 1.375% 02/05/2028 | EUR | 2.040.563,94 | 0,17 |
| 3.200.000 | LINDE FINANCE BV 0.550% 19/05/2032 EMTN | EUR | 3.239.323,74 | 0,27 |
| 1.286.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 0.875% 17/09/2026 | EUR | 1.325.340,30 | 0,11 |
| 397.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 1.625% 17/09/2031 | EUR | 428.103,30 | 0,04 |
| 3.000.000 | NATURGY FINANCE BV 0.750% 28/11/2029 EMTN | EUR | 3.077.492,61 | 0,26 |
| 3.200.000 | NATURGY FINANCE BV 1.250% 15/01/2026 EMTN | EUR | 3.361.963,46 | 0,28 |
| 600.000 | NIBC BANK NV 0.875% 08/07/2025 EMTN | EUR | 617.243,00 | 0,05 |
| 800.000 | NIBC BANK NV 1.125% 19/04/2023 EMTN | EUR | 816.556,08 | 0,07 |
| 1.200.000 | NIBC BANK NV 1.500% 31/01/2022 EMTN | EUR | 1.207.115,95 | 0,10 |
| 3.219.000 | RECKITT BENCKISER TREASURY SERVICES NEDERLAND BV 0.750% 19/05/2030 | EUR | 3.300.676,33 | 0,28 |
| 1.823.000 | SAGAX EURO MTN NL BV 0.750% 26/01/2028 EMTN | EUR | 1.811.738,56 | 0,15 |
| 1.987.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 0.500% 05/09/2034 EMTN | EUR | 1.975.207,83 | 0,17 |
| 1.195.000 | SIGNIFY NV 2.000% 11/05/2024 | EUR | 1.254.064,43 | 0,11 |
| 1.600.000 | SIGNIFY NV 2.375% 11/05/2027 | EUR | 1.766.088,93 | 0,15 |
| 6.154.000 | STELLANTIS NV 3.375% 07/07/2023 | EUR | 6.481.871,34 | 0,56 |
| 5.000.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 5.165.621,40 | 0,44 |
| 5.835.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 6.149.256,47 | 0,52 |
| 1.818.000 | TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN | EUR | 1.965.181,97 | 0,17 |
| 1.000.000 | UNILEVER FINANCE NETHERLANDS BV 0.500% 29/04/2024 EMTN | EUR | 1.021.561,91 | 0,09 |
| 300.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 332.923,69 | 0,03 |
| 1.500.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.738.122,18 | 0,15 |
| 4.400.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 4.514.366,47 | 0,38 |
| 4.200.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 4.640.438,92 | 0,39 |
| 300.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.500% 21/01/2041 EMTN | EUR | 292.651,27 | 0,02 |
| 600.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.875% 30/03/2027 | EUR | 650.140,82 | 0,06 |
| 900.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 4.125% 16/11/2038 | EUR | 1.243.139,00 | 0,11 |
| 1.800.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE 2.625% 16/11/2027 | EUR | 2.039.946,34 | 0,17 |
| 3.600.000 | VONOVIA FINANCE BV 0.625% 07/10/2027 EMTN | EUR | 3.648.518,24 | 0,31 |
| 4.200.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN | EUR | 4.305.377,24 | 0,36 |
| 600.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.500% 14/01/2028 | EUR | 640.239,33 | 0,05 |
| 100.000 | VONOVIA FINANCE BV 2.250% 15/12/2023 EMTN | EUR | 105.412,83 | 0,01 |
| 2.966.000 | WOLTERS KLUWER NV 0.750% 03/07/2030 | EUR | 3.030.043,41 | 0,26 |
| 1.800.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2.000% 23/02/2026 | EUR | 1.815.750,00 | 0,15 |
| | | | **208.741.082,36** | **17,68** |

**Vereinigte Staaten**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2.318.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.400% 15/02/2027 | EUR | 2.310.280,62 | 0,20 |
| 2.000.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.875% 21/05/2029 | EUR | 2.011.708,64 | 0,17 |
| 2.695.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.950% 05/10/2030 | EUR | 2.684.000,38 | 0,23 |
| 6.045.000 | AT&T INC 1.600% 19/05/2028 | EUR | 6.472.975,00 | 0,55 |
| 2.800.000 | AT&T INC 2.050% 19/05/2032 | EUR | 3.099.099,16 | 0,26 |
| 1.800.000 | AT&T INC 2.350% 05/09/2029 | EUR | 2.035.070,05 | 0,17 |
| 3.300.000 | AT&T INC 2.600% 17/12/2029 | EUR | 3.793.239,22 | 0,32 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.300.000 | AT&T INC 3.150% 04/09/2036 | EUR | 2.792.704,87 | 0,24 |
| 10.500.000 | AUTOLIV INC 0.750% 26/06/2023 | EUR | 10.643.856,20 | 0,90 |
| 9.005.000 | BANK OF AMERICA CORP 07/02/2025 FRN EMTN | EUR | 9.321.710,62 | 0,79 |
| 600.000 | BANK OF AMERICA CORP 0.750% 26/07/2023 EMTN | EUR | 611.562,75 | 0,05 |
| 1.471.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/03/2031 FRN EMTN | EUR | 1.467.502,62 | 0,12 |
| 700.000 | BANK OF AMERICA CORP 2.375% 19/06/2024 EMTN | EUR | 748.093,50 | 0,06 |
| 2.335.000 | BANK OF AMERICA CORP 24/08/2028 FRN EMTN | EUR | 2.358.146,04 | 0,20 |
| 178.000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 1.125% 26/09/2023 | EUR | 182.177,46 | 0,02 |
| 2.880.000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 1.250% 11/02/2025 | EUR | 2.981.692,48 | 0,25 |
| 2.280.000 | CITIGROUP INC 06/07/2026 FRN EMTN | EUR | 2.374.206,02 | 0,20 |
| 1.495.000 | CITIGROUP INC 08/10/2027 FRN EMTN | EUR | 1.507.904,20 | 0,13 |
| 500.000 | CITIGROUP INC 24/07/2026 FRN EMTN | EUR | 525.654,26 | 0,04 |
| 3.835.000 | COCA-COLA CO/THE 1.125% 09/03/2027 | EUR | 4.054.899,36 | 0,34 |
| 500.000 | COCA-COLA CO/THE 1.250% 08/03/2031 | EUR | 532.801,10 | 0,05 |
| 2.000.000 | COCA-COLA CO/THE 1.625% 09/03/2035 | EUR | 2.191.858,84 | 0,19 |
| 2.000.000 | COMCAST CORP 0.750% 20/02/2032 | EUR | 2.017.718,88 | 0,17 |
| 4.551.000 | ELI LILLY & CO 1.125% 14/09/2051 | EUR | 4.338.066,17 | 0,37 |
| 6.136.000 | EMERSON ELECTRIC CO 2.000% 15/10/2029 EMTN | EUR | 6.901.789,61 | 0,58 |
| 937.000 | EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033 | EUR | 931.330,66 | 0,08 |
| 8.862.000 | EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FUNDING 0.600% 16/06/2028 EMTN | EUR | 8.910.710,78 | 0,75 |
| 1.100.000 | GENERAL ELECTRIC CO 0.875% 17/05/2025 | EUR | 1.129.883,29 | 0,10 |
| 800.000 | GENERAL ELECTRIC CO 4.125% 19/09/2035 EMTN | EUR | 1.080.285,74 | 0,09 |
| 2.071.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 0.250% 26/01/2028 EMTN | EUR | 2.038.391,01 | 0,17 |
| 2.700.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.000% 18/03/2033 EMTN | EUR | 2.705.480,54 | 0,23 |
| 600.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 15/05/2024 EMTN | EUR | 614.603,45 | 0,05 |
| 3.500.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN | EUR | 3.507.283,54 | 0,30 |
| 2.695.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.300% 11/02/2028 | EUR | 2.702.428,63 | 0,23 |
| 750.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.950% 23/05/2025 | EUR | 777.815,31 | 0,07 |
| 1.397.000 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026 | EUR | 1.498.806,15 | 0,13 |
| 12.400.000 | JPMORGAN CHASE & CO 11/03/2027 FRN EMTN | EUR | 12.888.779,48 | 1,09 |
| 1.900.000 | JPMORGAN CHASE & CO 18/05/2028 FRN EMTN | EUR | 2.037.724,75 | 0,17 |
| 1.045.000 | JPMORGAN CHASE & CO 24/02/2028 FRN EMTN | EUR | 1.047.960,29 | 0,09 |
| 1.710.000 | LINDE INC/CT 1.625% 01/12/2025 | EUR | 1.837.454,47 | 0,16 |
| 578.000 | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 0.500% 25/05/2029 EMTN | EUR | 583.271,36 | 0,05 |
| 2.600.000 | MMS USA HOLDINGS INC 0.625% 13/06/2025 | EUR | 2.650.912,03 | 0,22 |
| 850.000 | MORGAN STANLEY 1.750% 11/03/2024 GMTN | EUR | 890.090,79 | 0,08 |
| 3.700.000 | MORGAN STANLEY 1.750% 30/01/2025 GMTN | EUR | 3.921.142,08 | 0,33 |
| 1.998.000 | MORGAN STANLEY 23/10/2026 FRN EMTN | EUR | 2.096.414,29 | 0,18 |
| 5.900.000 | MORGAN STANLEY 29/10/2027 FRN | EUR | 5.935.121,52 | 0,50 |
| 630.000 | NASDAQ INC 0.875% 13/02/2030 | EUR | 639.488,85 | 0,05 |
| 100.000 | NATIONAL GRID NORTH AMERICA INC 1.000% 12/07/2024 EMTN | EUR | 102.811,39 | 0,01 |
| 6.500.000 | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 04/10/2028 GMTN | EUR | 6.474.688,03 | 0,55 |
| 7.020.000 | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 23/01/2027 GMTN | EUR | 7.079.984,22 | 0,60 |
| 955.000 | PEPSICO INC 0.400% 09/10/2032 | EUR | 933.872,57 | 0,08 |
| 3.135.000 | PEPSICO INC 0.500% 06/05/2028 EMTN | EUR | 3.202.345,85 | 0,27 |
| 1.800.000 | PROCTER & GAMBLE CO/THE 1.200% 30/10/2028 | EUR | 1.935.710,23 | 0,16 |
| 1.800.000 | PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.875% 11/05/2027 | EUR | 2.290.855,19 | 0,19 |
| 745.000 | PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.375% 06/02/2028 | EUR | 749.829,88 | 0,06 |
| 872.000 | PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.500% 16/02/2032 | EUR | 846.512,30 | 0,07 |
| 2.218.000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.950% 24/07/2029 | EUR | 2.458.554,90 | 0,21 |
| 3.448.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.375% 22/03/2029 | EUR | 3.425.256,92 | 0,29 |
| 1.694.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.875% 08/04/2027 | EUR | 1.753.484,95 | 0,15 |
| 3.887.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035 | EUR | 3.853.792,12 | 0,33 |
| 6.000.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030 | EUR | 6.330.169,92 | 0,54 |
| | | | **179.821.965,53** | **15,23** |
| | **Frankreich** | | | |
| 2.900.000 | ALSTOM SA ZCP 11/01/2029 | EUR | 2.812.349,33 | 0,24 |
| 100.000 | ARKEMA SA 3.125% 06/12/2023 EMTN | EUR | 105.900,59 | 0,01 |
| 5.600.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.010% 11/05/2026 EMTN | EUR | 5.584.634,72 | 0,47 |
| 600.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN | EUR | 596.831,11 | 0,05 |
| 1.500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.250% 19/07/2028 | EUR | 1.473.243,14 | 0,12 |
| 5.900.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.625% 03/11/2028 EMTN | EUR | 5.936.118,50 | 0,50 |
| 5.700.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN | EUR | 5.879.362,01 | 0,50 |
| 6.700.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 17/07/2025 EMTN | EUR | 6.903.737,15 | 0,57 |
| 1.000.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.250% 03/06/2030 | EUR | 1.046.461,31 | 0,09 |
| 500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 24/03/2026 EMTN | EUR | 544.881,05 | 0,05 |
| 2.500.000 | BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN | EUR | 2.537.039,13 | 0,21 |
| 3.700.000 | BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN | EUR | 3.684.963,90 | 0,31 |
| 2.000.000 | BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN | EUR | 2.053.797,96 | 0,17 |
| 5.800.000 | BNP PARIBAS SA 15/01/2032 FRN EMTN | EUR | 5.884.181,08 | 0,50 |
| 1.200.000 | BNP PARIBAS SA 15/07/2025 FRN EMTN | EUR | 1.217.004,11 | 0,10 |
| 3.400.000 | BNP PARIBAS SA 19/02/2028 FRN EMTN | EUR | 3.406.266,30 | 0,29 |
| 2.600.000 | BNP PARIBAS SA 20/11/2030 FRN EMTN | EUR | 2.796.155,15 | 0,24 |
| 1.500.000 | BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN | EUR | 1.616.387,19 | 0,14 |
| 800.000 | BPCE SA 0.125% 04/12/2024 | EUR | 808.123,08 | 0,07 |
| 1.900.000 | BPCE SA 0.250% 14/01/2031 | EUR | 1.842.754,27 | 0,16 |
| 500.000 | BPCE SA 0.250% 15/01/2026 | EUR | 504.357,06 | 0,04 |
| 4.900.000 | BPCE SA 0.625% 15/01/2030 | EUR | 4.959.826,06 | 0,42 |
| 2.600.000 | BPCE SA 30/11/2027 FRN EMTN | EUR | 2.683.420,97 | 0,23 |
| 300.000 | CAPGEMINI SE 1.625% 15/04/2026 | EUR | 320.900,99 | 0,03 |
| 400.000 | CARREFOUR SA 1.000% 17/05/2027 EMTN | EUR | 417.694,37 | 0,04 |
| 1.100.000 | CARREFOUR SA 1.750% 04/05/2026 EMTN | EUR | 1.182.733,16 | 0,10 |
| 2.600.000 | CARREFOUR SA 2.625% 15/12/2027 EMTN | EUR | 2.967.375,63 | 0,25 |
| 5.400.000 | CCR RE SA 15/07/2040 FRN | EUR | 5.913.738,99 | 0,50 |
| 2.200.000 | CIE DE SAINT-GOBAIN 2.375% 04/10/2027 | EUR | 2.485.757,52 | 0,21 |
| 900.000 | COVIVIO 1.625% 23/06/2030 | EUR | 974.559,63 | 0,08 |
| 1.200.000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA FRN PERP | EUR | 1.365.701,38 | 0,12 |
| 800.000 | CREDIT AGRICOLE ASSURANCES SA 27/09/2048 FRN | EUR | 980.793,15 | 0,08 |
| 2.400.000 | CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 20/04/2028 EMTN | EUR | 2.378.061,34 | 0,20 |
| 4.800.000 | CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 21/10/2025 EMTN | EUR | 4.862.420,35 | 0,41 |
| 3.900.000 | CREDIT AGRICOLE SA 2.000% 25/03/2029 EMTN | EUR | 4.216.877,77 | 0,36 |
| 2.300.000 | CREDIT AGRICOLE SA 22/04/2026 FRN EMTN | EUR | 2.371.337,90 | 0,20 |
| 1.000.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 0.500% 24/06/2024 EMTN | EUR | 1.017.819,89 | 0,09 |
| 500.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 0.750% 05/12/2023 EMTN | EUR | 512.136,49 | 0,04 |
| 3.500.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.250% 14/04/2026 EMTN | EUR | 3.702.340,32 | 0,31 |
| 2.600.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 03/05/2027 EMTN | EUR | 2.779.122,55 | 0,24 |
| 300.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 13/03/2025 EMTN | EUR | 313.905,68 | 0,03 |
| 1.000.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.875% 20/12/2026 EMTN | EUR | 1.082.872,28 | 0,09 |
| 1.000.000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.010% 28/01/2026 EMTN | EUR | 998.291,19 | 0,08 |
| 1.000.000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.875% 07/05/2027 EMTN | EUR | 1.035.914,83 | 0,09 |
| 400.000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 25/10/2029 FRN EMTN | EUR | 417.554,92 | 0,04 |
| 2.900.000 | ELO SACA 2.875% 29/01/2026 EMTN | EUR | 3.201.509,55 | 0,27 |
| 3.800.000 | ESSILORLUXOTTICA SA 0.125% 27/05/2025 EMTN | EUR | 3.843.360,36 | 0,33 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.000.000 | ESSILORLUXOTTICA SA 0.500% 05/06/2028 EMTN | EUR | 1.025.835,01 | 0,09 |
| 1.000.000 | EUTELSAT SA 1.500% 13/10/2028 | EUR | 1.018.996,07 | 0,09 |
| 4.650.000 | FAURECIA SE 3.125% 15/06/2026 | EUR | 4.760.253,22 | 0,40 |
| 2.370.000 | FAURECIA SE 3.750% 15/06/2028 | EUR | 2.466.519,51 | 0,21 |
| 490.000 | FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.375% 30/10/2026 | EUR | 521.274,07 | 0,04 |
| 1.000.000 | HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.100% 03/09/2027 EMTN | EUR | 992.374,93 | 0,08 |
| 1.400.000 | ICADE SANTE SAS 1.375% 17/09/2030 | EUR | 1.467.090,24 | 0,12 |
| 1.000.000 | IMERYS SA 1.000% 15/07/2031 | EUR | 990.974,29 | 0,08 |
| 2.000.000 | IMERYS SA 1.500% 15/01/2027 EMTN | EUR | 2.112.381,14 | 0,18 |
| 1.700.000 | KERING SA 0.750% 13/05/2028 EMTN | EUR | 1.765.541,44 | 0,15 |
| 900.000 | LA POSTE SA 1.375% 21/04/2032 EMTN | EUR | 969.130,62 | 0,08 |
| 1.500.000 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE 0.375% 11/02/2031 | EUR | 1.517.293,53 | 0,13 |
| 400.000 | ORANGE SA FRN PERP EMTN | EUR | 475.136,08 | 0,04 |
| 1.000.000 | ORANGE SA ZCP 04/09/2026 EMTN | EUR | 998.877,72 | 0,08 |
| 1.900.000 | ORANGE SA 1.125% 15/07/2024 EMTN | EUR | 1.965.999,94 | 0,17 |
| 3.500.000 | ORANGE SA 1.375% 16/01/2030 EMTN | EUR | 3.793.929,27 | 0,32 |
| 2.400.000 | ORANGE SA 1.375% 20/03/2028 EMTN | EUR | 2.579.846,66 | 0,22 |
| 4.800.000 | ORANGE SA 1.625% 07/04/2032 EMTN | EUR | 5.313.663,65 | 0,45 |
| 600.000 | ORANGE SA 1.875% 12/09/2030 EMTN | EUR | 675.896,77 | 0,06 |
| 1.200.000 | PERNOD RICARD SA 0.500% 24/10/2027 | EUR | 1.228.958,00 | 0,10 |
| 2.200.000 | PSA BANQUE FRANCE SA 0.625% 21/06/2024 | EUR | 2.237.348,65 | 0,19 |
| 350.000 | PSA BANQUE FRANCE SA 0.750% 19/04/2023 EMTN | EUR | 354.973,29 | 0,03 |
| 1.600.000 | SOCIETE GENERALE SA 1.250% 12/06/2030 | EUR | 1.647.594,91 | 0,14 |
| 1.100.000 | SOCIETE GENERALE SA 21/04/2026 FRN EMTN | EUR | 1.135.032,86 | 0,10 |
| 2.200.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP | EUR | 2.205.500,00 | 0,19 |
| 500.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 488.809,74 | 0,04 |
| 1.200.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 1.240.500,00 | 0,11 |
| 2.440.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 2.696.200,00 | 0,23 |
| 3.850.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 3.941.918,60 | 0,33 |
| 6.600.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 6.956.116,53 | 0,58 |
| 200.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE FRN PERP | EUR | 199.533,88 | 0,02 |
| 2.100.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 0.875% 29/03/2032 EMTN | EUR | 2.069.163,01 | 0,18 |
| 200.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.375% 04/12/2031 EMTN | EUR | 207.537,97 | 0,02 |
| 100.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.750% 01/07/2049 EMTN | EUR | 96.995,16 | 0,01 |
| 200.000 | VALEO 0.625% 11/01/2023 EMTN | EUR | 201.423,07 | 0,02 |
| 390.000 | WPP FINANCE SA 2.375% 19/05/2027 EMTN | EUR | 435.660,93 | 0,04 |
| | | | **176.974.856,17** | **14,99** |
| | **Deutschland** | | | |
| 4.800.000 | ALBEMARLE NEW HOLDING GMBH 1.625% 25/11/2028 | EUR | 5.137.693,25 | 0,45 |
| 800.000 | ALSTRIA OFFICE REIT-AG 1.500% 15/11/2027 | EUR | 832.377,06 | 0,07 |
| 267.000 | COMMERZBANK AG 0.500% 04/12/2026 EMTN | EUR | 270.807,64 | 0,02 |
| 1.100.000 | COMMERZBANK AG 0.875% 22/01/2027 EMTN | EUR | 1.116.414,21 | 0,09 |
| 1.400.000 | COMMERZBANK AG 1.000% 04/03/2026 EMTN | EUR | 1.453.381,92 | 0,12 |
| 1.007.000 | COMMERZBANK AG 1.500% 28/08/2028 EMTN | EUR | 1.083.806,82 | 0,09 |
| 1.441.000 | CONTINENTAL AG ZCP 12/09/2023 | EUR | 1.445.099,75 | 0,12 |
| 1.742.000 | COVESTRO AG 0.875% 03/02/2026 EMTN | EUR | 1.797.118,05 | 0,15 |
| 542.000 | COVESTRO AG 1.375% 12/06/2030 EMTN | EUR | 578.455,58 | 0,05 |
| 700.000 | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH FRN PERP | EUR | 716.625,00 | 0,06 |
| 3.000.000 | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH FRN PERP | EUR | 3.007.607,40 | 0,25 |
| 4.000.000 | EUROGRID GMBH 1.500% 18/04/2028 EMTN | EUR | 4.309.794,16 | 0,37 |
| 3.700.000 | EVONIK INDUSTRIES AG 02/09/2081 FRN | EUR | 3.704.625,00 | 0,31 |
| 5.920.000 | LANXESS AG ZCP 08/09/2027 EMTN | EUR | 5.835.283,79 | 0,50 |
| 2.300.000 | MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.875% 05/07/2031 EMTN | EUR | 2.400.902,84 | 0,20 |
| 6.200.000 | MERCK KGAA 09/09/2080 FRN | EUR | 6.378.844,15 | 0,55 |
| 800.000 | MERCK KGAA 12/12/2074 FRN | EUR | 873.043,57 | 0,07 |
| 1.700.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2042 FRN EMTN | EUR | 1.767.677,10 | 0,15 |
| 3.700.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2042 FRN EMTN | GBP | 4.465.492,82 | 0,38 |
| 3.800.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2049 FRN | EUR | 4.384.860,24 | 0,37 |
| 4.300.000 | O2 TELEFONICA DEUTSCHLAND FINANZIERUNGS GMBH 1.750% 05/07/2025 | EUR | 4.540.918,12 | 0,38 |
| 1.300.000 | SANTANDER CONSUMER BANK AG 0.750% 17/10/2022 EMTN | EUR | 1.314.443,26 | 0,11 |
| 7.700.000 | SCHAEFFLER AG 2.750% 12/10/2025 EMTN | EUR | 8.199.225,65 | 0,70 |
| 800.000 | SCHAEFFLER AG 2.875% 26/03/2027 EMTN | EUR | 868.236,35 | 0,07 |
| 3.475.000 | SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025 | EUR | 3.634.543,89 | 0,31 |
| 1.659.000 | SYMRISE AG 1.375% 01/07/2027 | EUR | 1.750.048,24 | 0,15 |
| 2.150.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 3.375% 06/04/2028 EMTN | EUR | 2.531.200,42 | 0,21 |
| 3.100.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.625% 19/07/2029 EMTN | EUR | 3.083.500,47 | 0,26 |
| 2.700.000 | VONOVIA SE 0.250% 01/09/2028 EMTN | EUR | 2.652.055,07 | 0,22 |
| 3.100.000 | VONOVIA SE 0.625% 14/12/2029 EMTN | EUR | 3.098.947,21 | 0,26 |
| 3.100.000 | VONOVIA SE 0.750% 01/09/2032 EMTN | EUR | 3.021.810,87 | 0,26 |
| 500.000 | VONOVIA SE 1.000% 16/06/2033 | EUR | 497.221,27 | 0,04 |
| 900.000 | ZF FINANCE GMBH 2.750% 25/05/2027 EMTN | EUR | 932.482,29 | 0,08 |
| 300.000 | ZF FINANCE GMBH 3.000% 21/09/2025 EMTN | EUR | 315.750,00 | 0,03 |
| | | | **88.000.293,46** | **7,45** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 200.000 | AROUNDTOWN SA 1.450% 09/07/2028 EMTN | EUR | 209.201,83 | 0,02 |
| 800.000 | AROUNDTOWN SA 1.625% 31/01/2028 EMTN | EUR | 845.047,51 | 0,07 |
| 1.000.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA ZCP 01/04/2024 | EUR | 1.000.812,75 | 0,08 |
| 700.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.750% 25/03/2027 EMTN | EUR | 747.435,65 | 0,06 |
| 6.990.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN | EUR | 7.455.060,50 | 0,62 |
| 2.794.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031 | EUR | 2.815.655,60 | 0,24 |
| 2.200.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA FRN PERP EMTN | EUR | 2.167.000,00 | 0,18 |
| 2.400.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 0.125% 11/01/2028 EMTN | EUR | 2.321.618,98 | 0,20 |
| 700.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 1.375% 03/08/2026 EMTN | EUR | 734.867,53 | 0,06 |
| 1.200.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 1.500% 22/02/2027 EMTN | EUR | 1.266.700,67 | 0,11 |
| 3.600.000 | HANNOVER FINANCE LUXEMBOURG SA 30/06/2043 FRN | EUR | 3.904.173,25 | 0,33 |
| 2.930.000 | HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.125% 01/12/2027 EMTN | EUR | 3.068.000,92 | 0,26 |
| 4.145.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA FRN PERP | EUR | 4.336.706,25 | 0,37 |
| 1.217.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 23/04/2031 | EUR | 1.180.499,03 | 0,10 |
| 2.365.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 29/11/2026 EMTN | EUR | 2.405.384,15 | 0,20 |
| 1.591.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.625% 19/01/2033 EMTN | EUR | 1.524.716,70 | 0,13 |
| 1.609.000 | JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN | EUR | 1.890.383,67 | 0,16 |
| 1.622.000 | LOGICOR FINANCING SARL 0.875% 14/01/2031 EMTN | EUR | 1.569.244,89 | 0,13 |
| 4.889.000 | LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15/07/2027 EMTN | EUR | 5.147.551,49 | 0,44 |
| 200.000 | LOGICOR FINANCING SARL 3.250% 13/11/2028 EMTN | EUR | 231.291,82 | 0,02 |
| 5.635.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.375% 15/10/2028 | EUR | 5.666.565,30 | 0,48 |
| 5.080.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.750% 15/10/2032 | EUR | 5.113.253,58 | 0,43 |
| 1.000.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.375% 15/10/2040 | EUR | 1.013.520,84 | 0,09 |
| 2.000.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.500% 02/07/2039 | EUR | 2.085.272,20 | 0,18 |
| 180.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN | EUR | 193.134,63 | 0,02 |
| 1.074.000 | SEGRO CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031 | EUR | 1.051.141,64 | 0,09 |
| 300.000 | SELP FINANCE SARL 0.875% 27/05/2029 | EUR | 300.657,61 | 0,03 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 880.000 | SELP FINANCE SARL 1.500% 20/12/2026 | EUR | 925.857,50 | 0,08 |
| 6.567.000 | SES SA 1.625% 22/03/2026 EMTN | EUR | 6.968.074,21 | 0,59 |
| 900.000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN | EUR | 906.942,28 | 0,08 |
| 2.041.000 | TYCO ELECTRONICS GROUP SA ZCP 16/02/2029 | EUR | 1.982.599,50 | 0,17 |
| | | | **71.028.372,48** | **6,02** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 8.480.000 | AVIVA PLC 04/12/2045 FRN EMTN | EUR | 9.417.287,87 | 0,80 |
| 800.000 | BARCLAYS PLC 07/02/2028 FRN EMTN | EUR | 818.832,45 | 0,07 |
| 500.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 1.125% 12/04/2029 | EUR | 524.028,54 | 0,04 |
| 1.900.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 2.750% 06/05/2026 | EUR | 2.121.011,34 | 0,18 |
| 2.226.000 | DIAGEO FINANCE PLC 1.000% 22/04/2025 EMTN | EUR | 2.312.935,70 | 0,20 |
| 2.300.000 | FCE BANK PLC 1.615% 11/05/2023 EMTN | EUR | 2.343.590,13 | 0,20 |
| 1.669.000 | HSBC HOLDINGS PLC 24/09/2029 FRN | EUR | 1.662.093,34 | 0,14 |
| 1.028.000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 0.375% 28/01/2025 EMTN | EUR | 1.041.967,13 | 0,09 |
| 2.010.000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 2.375% 09/04/2026 EMTN | EUR | 2.214.803,78 | 0,19 |
| 1.419.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 01/04/2026 FRN EMTN | EUR | 1.588.102,24 | 0,13 |
| 200.000 | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC 0.875% 19/09/2024 EMTN | EUR | 205.706,98 | 0,02 |
| 300.000 | MONDI FINANCE PLC 1.625% 27/04/2026 EMTN | EUR | 319.370,45 | 0,03 |
| 500.000 | NATIONWIDE BUILDING SOCIETY 25/07/2029 FRN EMTN | EUR | 524.118,00 | 0,04 |
| 400.000 | NATWEST GROUP PLC 02/03/2026 FRN EMTN | EUR | 421.015,80 | 0,04 |
| 2.159.000 | NATWEST GROUP PLC 04/03/2025 FRN EMTN | EUR | 2.262.238,78 | 0,19 |
| 654.000 | NATWEST GROUP PLC 14/09/2032 FRN EMTN | EUR | 652.056,98 | 0,06 |
| 2.986.000 | NATWEST GROUP PLC 26/02/2030 FRN EMTN | EUR | 2.984.406,07 | 0,25 |
| 700.000 | NATWEST MARKETS PLC 2.750% 02/04/2025 EMTN | EUR | 767.414,40 | 0,06 |
| 1.700.000 | RENTOKIL INITIAL PLC 0.500% 14/10/2028 EMTN | EUR | 1.709.916,19 | 0,14 |
| 500.000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.125% 08/09/2023 | EUR | 512.753,44 | 0,04 |
| 1.875.000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 13/09/2029 FRN EMTN | EUR | 1.854.457,59 | 0,16 |
| 1.595.000 | STANDARD CHARTERED PLC 09/09/2030 FRN | EUR | 1.686.647,73 | 0,14 |
| 2.175.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN | EUR | 2.236.186,60 | 0,19 |
| 4.433.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.500% 02/05/2025 EMTN | GBP | 5.390.606,97 | 0,46 |
| 4.800.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.750% 27/04/2030 EMTN | GBP | 5.859.949,44 | 0,50 |
| | | | **51.431.497,94** | **4,36** |
| | **Italien** | | | |
| 1.500.000 | ENEL SPA FRN PERP | EUR | 1.658.401,55 | 0,14 |
| 3.800.000 | ENEL SPA 24/05/2080 FRN | EUR | 4.136.278,45 | 0,35 |
| 2.140.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.125% 16/11/2023 EMTN | EUR | 2.148.595,55 | 0,18 |
| 4.699.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.250% 28/02/2023 EMTN | EUR | 4.725.377,65 | 0,40 |
| 1.975.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.500% 13/09/2024 EMTN | EUR | 2.002.202,19 | 0,17 |
| 1.655.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.500% 18/09/2023 EMTN | EUR | 1.672.172,40 | 0,14 |
| 3.100.000 | INTESA SANPAOLO SPA 04/03/2029 FRN EMTN | EUR | 3.470.527,35 | 0,29 |
| 457.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 04/12/2024 EMTN | EUR | 468.309,45 | 0,04 |
| 1.250.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN | EUR | 1.265.497,15 | 0,11 |
| 1.460.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.000% 19/11/2026 EMTN | EUR | 1.505.987,88 | 0,13 |
| 1.920.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.750% 04/07/2029 EMTN | EUR | 2.066.823,17 | 0,18 |
| 2.600.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.750% 20/03/2028 EMTN | EUR | 2.785.731,26 | 0,24 |
| 500.000 | INTESA SANPAOLO SPA 2.125% 30/08/2023 EMTN | EUR | 522.636,39 | 0,04 |
| 850.000 | INTESA SANPAOLO SPA 4.000% 23/09/2029 | USD | 801.367,46 | 0,07 |
| 1.782.000 | ITALGAS SPA 0.250% 24/06/2025 EMTN | EUR | 1.793.476,90 | 0,15 |
| 775.000 | ITALGAS SPA 1.000% 11/12/2031 EMTN | EUR | 789.446,67 | 0,07 |
| 675.000 | MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.000% 08/09/2027 EMTN | EUR | 693.564,88 | 0,06 |
| 500.000 | SNAM SPA 1.000% 12/09/2034 EMTN | EUR | 504.053,65 | 0,04 |
| 1.400.000 | SNAM SPA 1.375% 25/10/2027 EMTN | EUR | 1.487.302,03 | 0,13 |
| 2.049.000 | UNICREDIT SPA 05/07/2029 FRN EMTN | EUR | 2.072.799,77 | 0,18 |
| 2.250.000 | UNICREDIT SPA 0.850% 19/01/2031 EMTN | EUR | 2.218.425,73 | 0,19 |
| 250.000 | UNICREDIT SPA 1.000% 18/01/2023 EMTN | EUR | 253.763,62 | 0,02 |
| 500.000 | UNICREDIT SPA 16/06/2026 FRN EMTN | EUR | 517.110,83 | 0,04 |
| 500.000 | UNICREDIT SPA 20/01/2026 FRN EMTN | EUR | 512.046,46 | 0,04 |
| 1.000.000 | UNICREDIT SPA 22/07/2027 FRN EMTN | EUR | 1.069.213,84 | 0,09 |
| 1.734.000 | UNICREDIT SPA 25/06/2025 FRN EMTN | EUR | 1.787.060,35 | 0,15 |
| | | | **42.928.172,63** | **3,64** |
| | **Irland** | | | |
| 1.600.000 | AIB GROUP PLC 1.250% 28/05/2024 EMTN | EUR | 1.655.400,78 | 0,14 |
| 2.364.000 | AIB GROUP PLC 17/11/2027 FRN EMTN | EUR | 2.373.365,01 | 0,20 |
| 654.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 08/07/2024 FRN EMTN | EUR | 663.493,11 | 0,06 |
| 1.253.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 10/05/2027 FRN EMTN | EUR | 1.248.313,73 | 0,11 |
| 637.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 1.375% 29/08/2023 EMTN | EUR | 655.114,93 | 0,06 |
| 9.893.000 | CCEP FINANCE IRELAND DAC ZCP 06/09/2025 | EUR | 9.903.579,18 | 0,83 |
| 4.063.000 | CCEP FINANCE IRELAND DAC 0.875% 06/05/2033 | EUR | 4.040.271,37 | 0,34 |
| 2.549.000 | FRESENIUS FINANCE IRELAND PLC 0.875% 01/10/2031 EMTN | EUR | 2.532.575,19 | 0,21 |
| 554.000 | HAMMERSON IRELAND FINANCE DAC 1.750% 03/06/2027 | EUR | 560.249,14 | 0,05 |
| 1.850.000 | KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 0.625% 20/09/2029 | EUR | 1.862.793,51 | 0,16 |
| 9.300.000 | KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 2.375% 10/09/2025 | EUR | 10.143.187,20 | 0,86 |
| 2.500.000 | SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC 2.875% 15/01/2026 | EUR | 2.767.295,75 | 0,23 |
| 656.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 0.500% 22/09/2029 | EUR | 652.269,88 | 0,06 |
| 1.193.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033 | EUR | 1.186.440,11 | 0,10 |
| | | | **40.244.348,89** | **3,41** |
| | **Spanien** | | | |
| 400.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 04/06/2025 FRN GMTN | EUR | 411.648,17 | 0,03 |
| 1.200.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 16/01/2030 FRN GMTN | EUR | 1.213.991,87 | 0,10 |
| 2.300.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 24/03/2027 FRN GMTN | EUR | 2.295.786,56 | 0,19 |
| 1.400.000 | BANCO DE SABADELL SA 1.625% 07/03/2024 EMTN | EUR | 1.454.924,53 | 0,12 |
| 1.400.000 | BANCO SANTANDER SA 0.200% 11/02/2028 EMTN | EUR | 1.388.596,13 | 0,12 |
| 1.900.000 | BANCO SANTANDER SA 0.250% 19/06/2024 EMTN | EUR | 1.921.651,26 | 0,16 |
| 1.200.000 | BANCO SANTANDER SA 24/06/2029 FRN EMTN | EUR | 1.203.005,53 | 0,10 |
| 4.000.000 | CAIXABANK SA 0.375% 03/02/2025 EMTN | EUR | 4.052.508,52 | 0,35 |
| 1.400.000 | CAIXABANK SA 0.750% 09/07/2026 | EUR | 1.437.415,84 | 0,12 |
| 3.400.000 | CAIXABANK SA 0.750% 18/04/2023 EMTN | EUR | 3.454.031,13 | 0,29 |
| 700.000 | CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN | EUR | 691.072,95 | 0,06 |
| 1.600.000 | CAIXABANK SA 10/07/2026 FRN EMTN | EUR | 1.636.918,10 | 0,14 |
| 4.900.000 | CAIXABANK SA 1.125% 17/05/2024 EMTN | EUR | 5.061.117,64 | 0,44 |
| 1.500.000 | CAIXABANK SA 1.125% 27/03/2026 EMTN | EUR | 1.565.393,51 | 0,13 |
| 1.100.000 | CAIXABANK SA 14/07/2028 FRN EMTN | EUR | 1.146.989,36 | 0,10 |
| 2.400.000 | CAIXABANK SA 17/04/2030 FRN EMTN | EUR | 2.527.453,61 | 0,21 |
| 1.000.000 | CAIXABANK SA 1.750% 24/10/2023 EMTN | EUR | 1.039.201,04 | 0,09 |
| 200.000 | CAIXABANK SA 18/06/2031 FRN EMTN | EUR | 202.474,11 | 0,02 |
| 700.000 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 1.750% 26/05/2025 EMTN | EUR | 738.309,96 | 0,06 |
| 600.000 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 1.875% 04/12/2034 | EUR | 598.447,19 | 0,05 |
| 800.000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.375% 27/06/2024 EMTN | EUR | 810.681,46 | 0,07 |
| 2.600.000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.500% 14/11/2026 EMTN | EUR | 2.639.523,38 | 0,22 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 300.000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.875% 30/05/2023 EMTN | EUR | 305.988,00 | 0,03 |
| 1.100.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.069% 05/02/2024 EMTN | EUR | 1.130.384,73 | 0,10 |
| 1.000.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.528% 17/01/2025 EMTN | EUR | 1.055.154,42 | 0,09 |
| | | | **39.982.669,00** | **3,39** |
| | **Japan** | | | |
| 3.300.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.336% 19/04/2027 | EUR | 3.312.593,39 | 0,28 |
| 5.425.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.541% 23/10/2028 | EUR | 5.460.840,10 | 0,46 |
| 1.500.000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.339% 19/07/2024 | EUR | 1.520.090,13 | 0,13 |
| 3.000.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 0.750% 09/07/2027 | EUR | 3.083.341,83 | 0,26 |
| 3.900.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.375% 09/07/2032 | EUR | 4.076.719,80 | 0,35 |
| 9.520.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.250% 21/11/2026 | EUR | 10.493.630,20 | 0,89 |
| 2.500.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030 | EUR | 2.990.536,63 | 0,25 |
| | | | **30.937.752,08** | **2,62** |
| | **Schweden** | | | |
| 2.300.000 | ESSITY AB 0.500% 03/02/2030 | EUR | 2.300.094,76 | 0,19 |
| 4.200.000 | ESSITY AB 1.125% 05/03/2025 EMTN | EUR | 4.359.243,67 | 0,37 |
| 1.700.000 | ESSITY AB 1.125% 27/03/2024 EMTN | EUR | 1.750.325,32 | 0,15 |
| 300.000 | ESSITY AB 1.625% 30/03/2027 EMTN | EUR | 322.648,08 | 0,03 |
| 475.000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.125% 29/01/2027 EMTN | EUR | 485.435,58 | 0,04 |
| 100.000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.875% 14/03/2025 | EUR | 105.176,02 | 0,01 |
| 200.000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.875% 23/01/2026 | EUR | 211.332,47 | 0,02 |
| 2.500.000 | HEIMSTADEN BOSTAD AB FRN PERP | EUR | 2.438.282,43 | 0,21 |
| 6.250.000 | SCANIA CV AB 2.250% 03/06/2025 EMTN | EUR | 6.734.037,00 | 0,57 |
| 3.000.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 02/03/2028 FRN EMTN | EUR | 3.055.540,02 | 0,26 |
| 1.699.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 1.000% 15/04/2025 EMTN | EUR | 1.770.133,04 | 0,15 |
| 6.779.000 | TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON 1.00% 26/05/2029 EMTN | EUR | 6.822.667,67 | 0,57 |
| | | | **30.354.916,06** | **2,57** |
| | **Schweiz** | | | |
| 9.300.000 | UBS AG/LONDON 0.010% 31/03/2026 EMTN | EUR | 9.276.916,94 | 0,79 |
| 12.311.000 | UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN | EUR | 12.206.817,92 | 1,03 |
| 1.000.000 | UBS GROUP AG 1.500% 30/11/2024 | EUR | 1.035.666,22 | 0,09 |
| 3.535.000 | UBS GROUP AG 29/01/2026 FRN EMTN | EUR | 3.557.787,10 | 0,30 |
| | | | **26.077.188,18** | **2,21** |
| | **Finnland** | | | |
| 4.800.000 | FINGRID OYJ 3.500% 03/04/2024 EMTN | EUR | 5.247.133,54 | 0,45 |
| 1.355.000 | METSO OUTOTEC OYJ 0.875% 26/05/2028 EMTN | EUR | 1.375.177,59 | 0,12 |
| 3.600.000 | OP CORPORATE BANK PLC 0.100% 16/11/2027 EMTN | EUR | 3.580.703,28 | 0,31 |
| 2.194.000 | OP CORPORATE BANK PLC 09/06/2030 FRN | EUR | 2.272.764,78 | 0,19 |
| 1.055.000 | SAMPO OYJ 03/09/2052 FRN EMTN | EUR | 1.121.092,95 | 0,09 |
| 3.337.000 | SAMPO OYJ 23/05/2049 FRN | EUR | 3.804.439,92 | 0,32 |
| 1.865.000 | SATO OYJ 1.375% 24/02/2028 | EUR | 1.939.948,34 | 0,16 |
| 1.606.000 | STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN | EUR | 1.606.908,29 | 0,14 |
| 3.275.000 | UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN | EUR | 3.220.102,32 | 0,27 |
| 1.000.000 | UPM-KYMMENE OYJ 0.500% 22/03/2031 EMTN | EUR | 984.202,13 | 0,08 |
| | | | **25.152.473,14** | **2,13** |
| | **Belgien** | | | |
| 5.405.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 1.150% 22/01/2027 EMTN | EUR | 5.689.576,49 | 0,49 |
| 1.800.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.000% 17/03/2028 EMTN | EUR | 2.002.307,06 | 0,17 |
| 800.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN | EUR | 956.843,60 | 0,08 |
| 2.223.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.875% 02/04/2032 EMTN | EUR | 2.680.633,18 | 0,23 |
| 1.300.000 | BELFIUS BANK SA 0.010% 15/10/2025 EMTN | EUR | 1.300.991,46 | 0,11 |
| 2.500.000 | KBC GROUP NV 03/12/2029 FRN EMTN | EUR | 2.509.703,30 | 0,21 |
| 3.600.000 | KBC GROUP NV 07/12/2031 FRN EMTN | EUR | 3.579.648,05 | 0,30 |
| 1.000.000 | KBC GROUP NV 0.750% 31/05/2031 EMTN | EUR | 999.160,74 | 0,08 |
| 1.900.000 | KBC GROUP NV 11/03/2027 FRN EMTN | EUR | 1.915.754,52 | 0,16 |
| 1.400.000 | SOLVAY SA FRN PERP | EUR | 1.492.734,11 | 0,13 |
| | | | **23.127.352,51** | **1,96** |
| | **Österreich** | | | |
| 2.000.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.375% 16/04/2024 EMTN | EUR | 2.031.475,32 | 0,17 |
| 600.000 | ERSTE GROUP BANK AG 08/09/2031 FRN EMTN | EUR | 622.805,40 | 0,05 |
| 3.600.000 | ERSTE GROUP BANK AG 10/06/2030 FRN EMTN | EUR | 3.645.869,76 | 0,31 |
| 7.900.000 | ERSTE GROUP BANK AG 16/11/2028 FRN EMTN | EUR | 7.789.306,86 | 0,66 |
| 1.000.000 | MONDI FINANCE EUROPE GMBH 2.375% 01/04/2028 EMTN | EUR | 1.119.255,20 | 0,09 |
| 400.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.375% 25/09/2026 EMTN | EUR | 405.886,10 | 0,03 |
| 1.200.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 1.000% 04/12/2023 EMTN | EUR | 1.231.931,20 | 0,10 |
| 300.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 18/06/2032 FRN | EUR | 327.642,04 | 0,03 |
| 1.250.000 | VOESTALPINE AG 2.250% 14/10/2021 EMTN | EUR | 1.249.893,46 | 0,11 |
| | | | **18.424.065,34** | **1,55** |
| | **Australien** | | | |
| 3.747.000 | TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 2.280% 21/10/2027 EMTN | EUR | 4.216.712,53 | 0,36 |
| 4.145.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.750% 29/03/2028 EMTN | EUR | 4.460.025,93 | 0,38 |
| 100.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.875% 16/09/2024 EMTN | EUR | 105.298,26 | 0,01 |
| 2.500.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 3.000% 08/04/2030 EMTN | EUR | 2.942.809,78 | 0,25 |
| 2.422.000 | WESTPAC BANKING CORP 0.875% 17/04/2027 EMTN | EUR | 2.526.878,75 | 0,21 |
| 1.629.000 | WESTPAC BANKING CORP 13/05/2031 FRN | EUR | 1.629.742,34 | 0,14 |
| | | | **15.881.467,59** | **1,35** |
| | **Portugal** | | | |
| 4.500.000 | BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.000% 22/03/2023 EMTN | EUR | 4.643.997,93 | 0,39 |
| 6.500.000 | BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN | EUR | 7.263.055,15 | 0,61 |
| 2.800.000 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 20/07/2080 FRN | EUR | 2.835.000,00 | 0,24 |
| 1.000.000 | ENERGIAS DE PORTUGAL SA 02/08/2081 FRN | EUR | 1.013.708,13 | 0,09 |
| | | | **15.755.761,21** | **1,33** |
| | **Jersey** | | | |
| 11.760.000 | APTIV PLC 1.500% 10/03/2025 | EUR | 12.285.624,61 | 1,04 |
| | | | **12.285.624,61** | **1,04** |
| | **Island** | | | |
| 300.000 | ARION BANKI HF 0.625% 27/05/2024 EMTN | EUR | 303.764,69 | 0,03 |
| 759.000 | ARION BANKI HF 1.625% 01/12/2021 EMTN | EUR | 761.157,46 | 0,06 |
| 3.720.000 | ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN | EUR | 3.771.856,65 | 0,32 |
| 4.000.000 | LANDSBANKINN HF 0.500% 20/05/2024 EMTN | EUR | 4.038.513,40 | 0,34 |
| 1.755.000 | LANDSBANKINN HF 1.000% 30/05/2023 EMTN | EUR | 1.785.686,65 | 0,15 |
| | | | **10.660.978,85** | **0,90** |
| | **Kanada** | | | |
| 4.667.000 | FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028 | EUR | 5.169.571,73 | 0,43 |
| 300.000 | MAGNA INTERNATIONAL INC 1.500% 25/09/2027 | EUR | 322.902,49 | 0,03 |
| 4.390.000 | MAGNA INTERNATIONAL INC 1.900% 24/11/2023 | EUR | 4.573.877,39 | 0,39 |
| | | | **10.066.351,61** | **0,85** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Neuseeland** | | | |
| 993.000 | ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 0.200% 23/09/2027 EMTN | EUR | 988.198,01 | 0,08 |
| 1.500.000 | ANZ NEW ZEALAND INT'L LTD/LONDON 1.125% 20/03/2025 EMTN | EUR | 1.561.701,39 | 0,13 |
| 1.000.000 | ASB FINANCE LTD 0.250% 08/09/2028 EMTN | EUR | 988.887,88 | 0,08 |
| 1.805.000 | BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.375% 14/09/2024 GMTN | EUR | 1.834.104,34 | 0,16 |
| 2.075.000 | BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.500% 13/05/2023 GMTN | EUR | 2.103.764,90 | 0,18 |
| 1.509.000 | WESTPAC SECURITIES NZ LTD/LONDON 0.100% 13/07/2027 | EUR | 1.491.408,50 | 0,13 |
| | | | **8.968.065,02** | **0,76** |
| | **Norwegen** | | | |
| 6.300.000 | DNB BANK ASA 01/03/2027 FRN EMTN | EUR | 6.333.534,71 | 0,53 |
| 600.000 | NORSK HYDRO ASA 1.125% 11/04/2025 | EUR | 619.521,79 | 0,05 |
| 1.723.000 | SPAREBANK 1 SR-BANK ASA 15/07/2027 FRN EMTN | EUR | 1.718.275,81 | 0,15 |
| | | | **8.671.332,31** | **0,73** |
| | **Dänemark** | | | |
| 3.742.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.375% 30/06/2027 | EUR | 3.785.085,43 | 0,32 |
| 490.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.625% 09/03/2030 EMTN | EUR | 495.216,04 | 0,04 |
| 1.000.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.875% 01/07/2029 EMTN | EUR | 1.032.334,99 | 0,09 |
| 1.395.000 | JYSKE BANK AS 15/10/2025 FRN EMTN | EUR | 1.409.832,00 | 0,12 |
| | | | **6.722.468,46** | **0,57** |
| | **Singapur** | | | |
| 5.930.000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD 11/04/2028 FRN GMTN | EUR | 6.065.767,88 | 0,51 |
| | | | **6.065.767,88** | **0,51** |
| | **Bermuda** | | | |
| 4.800.000 | BACARDI LTD 2.750% 03/07/2023 | EUR | 5.030.381,66 | 0,43 |
| | | | **5.030.381,66** | **0,43** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 2.095.000 | XLIT LTD 29/06/2047 FRN | EUR | 2.352.287,52 | 0,20 |
| | | | **2.352.287,52** | **0,20** |
| | | | **1.155.687.492,49** | **97,88** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **1.155.687.492,49** | **97,88** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swaps** | | | | | | |
| CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026 | Verkauf | 1,000 | 20/06/2026 | EUR | 3.000.000,00 | 55.804,65 |
| CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026 | Verkauf | 1,000 | 20/06/2026 | EUR | 2.800.000,00 | 52.084,34 |
| CDS MICHELIN LUXEMBOURG SCS 2.7500% 20/06/2019 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2023 | EUR | 1.360.000,00 | 26.538,58 |
| CDS HANNOVER RUECK SE 1.000% 20/06/2026 | Verkauf | 1,000 | 20/06/2026 | EUR | 1.400.000,00 | 26.042,17 |
| | | | | | | **160.469,74** |

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| **Zinsswaps** | | | | | |
| 0.789 | Floating | 20/12/2027 | EUR | 1.000.000,00 | 55.411,24 |
| 0.201 | Floating | 13/03/2022 | EUR | 5.000.000,00 | 16.587,85 |
| | | | | | **71.999,09** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 16.337.306,29 | EUR | 14.061.000,00 | GBP | 31/12/2021 | 16.337.306,29 | 7.775,17 |
| 1.857.788,07 | EUR | 2.175.000,00 | USD | 31/12/2021 | 1.857.788,07 | (15.058,16) |
| | | | | | **18.195.094,36** | **(7.282,99)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| (300) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 40.479.000,00 | 235.510,00 |
| (171) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 29.039.220,00 | 322.349,90 |
| 62 | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 12.607.080,00 | (440.200,00) |
| 490 | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 54.980.450,00 | (39.200,00) |
| (49) | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 7.134.521,45 | 221.760,20 |
| (6) | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 824.291,38 | 21.881,34 |
| (5) | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 529.540,48 | 3.303,09 |
| | | | **145.594.103,31** | **325.404,53** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **550.590,37** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **1.155.687.492,49** | **97,88** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **550.590,37** | **0,05** |
| **Bankguthaben** | **33.114.621,51** | **2,80** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(8.618.953,20)** | **(0,73)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **1.180.733.751,17** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 508.800.479,02 |
| | 30.09.2020 | EUR | 537.277.019,53 |
| | 30.09.2019 | EUR | 543.888.725,40 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 8.534,04 |
| | 30.09.2020 | EUR | 8.422,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 8.388,65 |
| Capitalisation I Duration Hedged (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.047,94 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 416,61 |
| | 30.09.2020 | EUR | 410,93 |
| | 30.09.2019 | EUR | 409,01 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 416,95 |
| | 30.09.2020 | EUR | 410,93 |
| | 30.09.2019 | EUR | 408,88 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 404,25 |
| | 30.09.2020 | EUR | 400,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | 400,27 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 408,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 403,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 402,00 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 320,42 |
| | 30.09.2020 | EUR | 317,71 |
| | 30.09.2019 | EUR | 317,89 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.257,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.245,80 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.245,17 |
| Distribution P Duration Hedged (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 251,07 |
| | 30.09.2019 | EUR | 249,07 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.265,78 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.251,01 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.248,52 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 49.984 |
| | 30.09.2020 | | 46.184 |
| | 30.09.2019 | | 42.520 |
| Capitalisation I Duration Hedged (EUR) | 30.09.2021 | | - |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | 6.099 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 6.430 |
| | 30.09.2020 | 9.282 |
| | 30.09.2019 | 9.737 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 23.322 |
| | 30.09.2020 | 197.023 |
| | 30.09.2019 | 275.624 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 121.997 |
| | 30.09.2020 | 116.670 |
| | 30.09.2019 | 4.218 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1.492 |
| | 30.09.2020 | 1.810 |
| | 30.09.2019 | 56.154 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 45.055 |
| | 30.09.2020 | 27.459 |
| | 30.09.2019 | 10.844 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 3.688 |
| | 30.09.2020 | 4.418 |
| | 30.09.2019 | 3.906 |
| Distribution P Duration Hedged (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 3.835 |
| | 30.09.2019 | 28.141 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 659 |
| | 30.09.2020 | 683 |
| | 30.09.2019 | 125 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Dividende** | | | |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,85 |

| | | |
|---|---|---|
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,43% |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 0,39% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,85% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 0,85% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 57,01% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **498.357.805,40** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 498.357.805,40 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **290.475,59** |
| Credit Default Swaps | | 20.489,34 |
| Futures | | 269.986,25 |
| **Bankguthaben** | | **7.780.880,06** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **223.411,31** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **10.631.658,12** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***517.284.230,48*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(8.429.222,96)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(54.528,50)** |
| Zinsswaps | | (37.910,14) |
| Devisentermingeschäfte | | (16.618,36) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(8.483.751,46)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***508.800.479,02*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **5.745.971,17** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 5.658.135,48 |
| Zinsen auf Swaps | | 62.385,69 |
| Sonstige Erträge | 10 | 25.450,00 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(2.853.124,84)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.035.407,37) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (665.639,77) |
| Abonnementsteuer | 9 | (92.931,01) |
| Bankzinsen | | (59.146,69) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **2.892.846,33** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 12.828.209,25 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (3.901.060,78) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 2.622.890,96 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (2.607.450,20) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 86.302,95 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (83.325,57) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (5.500.511,35) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 289.023,90 |
| **Ergebnis** | | **6.626.925,49** |
| Zeichnungen | | 111.800.306,62 |
| Rücknahmen | | (146.903.208,22) |
| Ausschüttung | | (564,40) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 537.277.019,53 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***508.800.479,02*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Niederlande** | | | | |
| 1.947.000 | ADECCO INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV 0.125% 21/09/2028 EMTN | EUR | 1.913.765,76 | 0,38 |
| 1.216.000 | ADECCO INTERNATIONAL FINANCIAL SERVICES BV 0.500% 21/09/2031 EMTN | EUR | 1.194.536,10 | 0,23 |
| 1.491.000 | AGCO INTERNATIONAL HOLDINGS BV 0.800% 06/10/2028 | EUR | 1.498.489,01 | 0,29 |
| 205.000 | AKZO NOBEL NV 1.625% 14/04/2030 EMTN | EUR | 224.394,30 | 0,04 |
| 2.165.000 | ALLIANDER NV FRN PERP | EUR | 2.249.707,90 | 0,44 |
| 1.730.000 | ALLIANDER NV 0.375% 10/06/2030 EMTN | EUR | 1.745.185,68 | 0,34 |
| 2.100.000 | ALLIANDER NV 0.875% 22/04/2026 EMTN | EUR | 2.190.270,26 | 0,43 |
| 1.600.000 | ALLIANDER NV 2.875% 14/06/2024 EMTN | EUR | 1.737.955,79 | 0,34 |
| 400.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 2.000% 17/09/2030 | EUR | 453.777,35 | 0,09 |
| 1.419.000 | ASML HOLDING NV 0.250% 25/02/2030 | EUR | 1.410.780,53 | 0,28 |
| 454.000 | ASML HOLDING NV 0.625% 07/05/2029 | EUR | 467.490,46 | 0,09 |
| 3.640.000 | BMW FINANCE NV ZCP 24/03/2023 EMTN | EUR | 3.660.038,13 | 0,72 |
| 2.600.000 | BRENNTAG FINANCE BV 0.500% 06/10/2029 EMTN | EUR | 2.584.288,28 | 0,51 |
| 2.275.000 | BRENNTAG FINANCE BV 1.125% 27/09/2025 | EUR | 2.366.947,97 | 0,47 |
| 1.749.000 | CONTI-GUMMI FINANCE BV 1.125% 25/09/2024 | EUR | 1.804.542,22 | 0,35 |
| 1.328.000 | DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN | EUR | 1.317.538,77 | 0,26 |
| 999.000 | DANFOSS FINANCE II BV 0.750% 28/04/2031 EMTN | EUR | 996.698,05 | 0,20 |
| 3.000.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 0.875% 30/01/2024 EMTN | EUR | 3.078.396,00 | 0,61 |
| 1.250.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 03/04/2028 EMTN | EUR | 1.355.083,16 | 0,27 |
| 200.000 | DEUTSCHE TELEKOM INTERNATIONAL FINANCE BV 3.250% 17/01/2028 EMTN | EUR | 239.702,29 | 0,05 |
| 1.285.000 | ELM BV FOR FIRMENICH INTERNATIONAL SA FRN PERP | EUR | 1.381.458,19 | 0,27 |
| 3.092.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.500% 17/06/2030 EMTN | EUR | 3.078.655,95 | 0,61 |
| 4.728.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 0.875% 28/09/2034 EMTN | EUR | 4.679.882,34 | 0,92 |
| 2.890.000 | ENEXIS HOLDING NV 0.750% 02/07/2031 EMTN | EUR | 2.986.125,59 | 0,59 |
| 1.700.000 | ENEXIS HOLDING NV 0.875% 28/04/2026 EMTN | EUR | 1.771.182,67 | 0,35 |
| 300.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 31/07/2029 EMTN | EUR | 324.569,10 | 0,06 |
| 4.100.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN | EUR | 6.253.096,71 | 1,23 |
| 385.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.000% 22/04/2027 | EUR | 403.701,24 | 0,08 |
| 340.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.625% 22/04/2032 | EUR | 373.430,74 | 0,07 |
| 700.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 715.130,54 | 0,14 |
| 1.500.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 1.513.920,38 | 0,30 |
| 4.000.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 4.130.000,00 | 0,81 |
| 2.900.000 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 0.250% 26/06/2025 | EUR | 2.933.204,04 | 0,58 |
| 670.000 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 1.750% 02/04/2027 | EUR | 726.938,48 | 0,14 |
| 1.930.000 | KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN | EUR | 1.951.283,54 | 0,38 |
| 3.000.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 0.500% 22/05/2026 | EUR | 3.069.248,04 | 0,60 |
| 4.955.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 1.375% 02/05/2028 | EUR | 5.321.575,95 | 1,04 |
| 3.000.000 | LINDE FINANCE BV 0.550% 19/05/2032 EMTN | EUR | 3.036.866,01 | 0,60 |
| 140.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 1.625% 17/09/2031 | EUR | 150.968,42 | 0,03 |
| 3.000.000 | NATURGY FINANCE BV 0.750% 28/11/2029 EMTN | EUR | 3.077.492,61 | 0,60 |
| 3.700.000 | NATURGY FINANCE BV 0.875% 15/05/2025 EMTN | EUR | 3.818.896,87 | 0,75 |
| 1.000.000 | RELX FINANCE BV 0.500% 10/03/2028 | EUR | 1.012.400,02 | 0,20 |
| 300.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 0.250% 20/02/2029 EMTN | EUR | 301.671,45 | 0,06 |
| 2.108.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 0.500% 05/09/2034 EMTN | EUR | 2.095.489,74 | 0,41 |
| 1.695.000 | SIGNIFY NV 2.000% 11/05/2024 | EUR | 1.778.777,58 | 0,35 |
| 950.000 | SIGNIFY NV 2.375% 11/05/2027 | EUR | 1.048.615,30 | 0,21 |
| 3.414.000 | STELLANTIS NV 3.375% 07/07/2023 | EUR | 3.595.890,27 | 0,71 |
| 2.000.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 2.066.248,56 | 0,41 |
| 1.255.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 1.322.590,72 | 0,26 |
| 1.019.000 | TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN | EUR | 1.101.496,39 | 0,22 |
| 2.000.000 | UNILEVER FINANCE NETHERLANDS BV 1.000% 14/02/2027 EMTN | EUR | 2.111.024,76 | 0,41 |
| 400.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 424.500,00 | 0,08 |
| 400.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 463.499,25 | 0,09 |
| 1.200.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.325.839,69 | 0,26 |
| 1.200.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.331.694,76 | 0,26 |
| 1.200.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.353.438,40 | 0,27 |
| 1.300.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.396.148,69 | 0,27 |
| 1.800.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.846.786,28 | 0,36 |
| 500.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.500% 21/01/2041 EMTN | EUR | 487.752,12 | 0,10 |
| 400.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 4.125% 16/11/2038 | EUR | 552.506,22 | 0,11 |
| 700.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE 2.625% 16/11/2027 | EUR | 793.312,46 | 0,16 |
| 2.741.000 | WOLTERS KLUWER NV 0.750% 03/07/2030 | EUR | 2.800.185,10 | 0,55 |
| 1.100.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2.000% 23/02/2026 | EUR | 1.109.625,00 | 0,22 |
| | | | **114.506.708,18** | **22,51** |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 828.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.400% 15/02/2027 | EUR | 825.242,60 | 0,16 |
| 2.000.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.875% 21/05/2029 | EUR | 2.011.708,64 | 0,40 |
| 1.573.000 | AMERICAN TOWER CORP 0.950% 05/10/2030 | EUR | 1.566.579,82 | 0,31 |
| 3.135.000 | AT&T INC 1.600% 19/05/2028 | EUR | 3.356.952,29 | 0,66 |
| 1.000.000 | AT&T INC 2.350% 05/09/2029 | EUR | 1.130.594,47 | 0,22 |
| 2.500.000 | AT&T INC 2.450% 15/03/2035 | EUR | 2.819.619,08 | 0,55 |
| 4.100.000 | AT&T INC 2.600% 17/12/2029 | EUR | 4.712.812,36 | 0,93 |
| 1.000.000 | AT&T INC 3.150% 04/09/2036 | EUR | 1.214.219,51 | 0,24 |
| 2.000.000 | AT&T INC 4.250% 01/03/2027 | USD | 1.953.308,60 | 0,38 |
| 4.098.000 | AUTOLIV INC 0.750% 26/06/2023 | EUR | 4.154.145,02 | 0,82 |
| 280.000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 1.125% 26/09/2023 | EUR | 286.571,29 | 0,06 |
| 2.956.000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 1.250% 11/02/2025 | EUR | 3.060.376,03 | 0,60 |
| 1.000.000 | COCA-COLA CO/THE 1.250% 08/03/2031 | EUR | 1.065.602,20 | 0,21 |
| 2.045.000 | COCA-COLA CO/THE 1.625% 09/03/2035 | EUR | 2.241.175,66 | 0,44 |
| 2.022.000 | ELI LILLY & CO 1.125% 14/09/2051 | EUR | 1.927.393,94 | 0,38 |
| 4.171.000 | EMERSON ELECTRIC CO 2.000% 15/10/2029 EMTN | EUR | 4.691.552,23 | 0,91 |
| 537.000 | GENERAL ELECTRIC CO 4.125% 19/09/2035 EMTN | EUR | 725.141,80 | 0,14 |
| 1.200.000 | ILLINOIS TOOL WORKS INC 0.625% 05/12/2027 | EUR | 1.232.139,56 | 0,24 |
| 1.350.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.300% 11/02/2028 | EUR | 1.353.721,21 | 0,27 |
| 2.000.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 0.950% 23/05/2025 | EUR | 2.074.174,16 | 0,41 |
| 3.720.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.250% 29/01/2027 | EUR | 3.937.951,75 | 0,77 |
| 1.693.000 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026 | EUR | 1.816.377,10 | 0,36 |
| 1.500.000 | MMS USA HOLDINGS INC 0.625% 13/06/2025 | EUR | 1.529.372,33 | 0,30 |
| 500.000 | PEPSICO INC 0.400% 09/10/2032 | EUR | 488.938,52 | 0,10 |
| 3.295.000 | PEPSICO INC 0.500% 06/05/2028 EMTN | EUR | 3.365.782,96 | 0,66 |
| 2.500.000 | PROCTER & GAMBLE CO/THE 4.875% 11/05/2027 | EUR | 3.181.743,33 | 0,63 |
| 1.700.000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.950% 24/07/2029 | EUR | 1.884.374,81 | 0,37 |
| 2.069.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.375% 22/03/2029 | EUR | 2.055.352,83 | 0,40 |
| 500.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.875% 02/04/2025 | EUR | 516.298,35 | 0,10 |
| 1.827.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 0.875% 08/04/2027 | EUR | 1.891.155,25 | 0,37 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.749.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.125% 19/09/2035 | EUR | 1.734.057,73 | 0,34 |
| 1.000.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030 | EUR | 1.055.028,32 | 0,21 |
| 3.000.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.300% 18/05/2033 | EUR | 3.113.214,96 | 0,61 |
| 300.000 | VF CORP 0.625% 25/02/2032 | EUR | 294.142,39 | 0,06 |
| | | | **69.266.821,10** | **13,61** |
| | **Deutschland** | | | |
| 3.380.000 | ALBEMARLE NEW HOLDING GMBH 1.625% 25/11/2028 | EUR | 3.617.792,33 | 0,71 |
| 4.085.000 | CONTINENTAL AG ZCP 12/09/2023 | EUR | 4.096.622,11 | 0,81 |
| 1.015.000 | COVESTRO AG 0.875% 03/02/2026 EMTN | EUR | 1.047.115,28 | 0,21 |
| 1.015.000 | COVESTRO AG 1.375% 12/06/2030 EMTN | EUR | 1.083.270,14 | 0,21 |
| 2.200.000 | DEUTSCHE BAHN FINANCE GMBH FRN PERP | EUR | 2.252.250,00 | 0,44 |
| 1.800.000 | E.ON SE 0.750% 18/12/2030 EMTN | EUR | 1.838.886,44 | 0,36 |
| 2.800.000 | EUROGRID GMBH 1.500% 18/04/2028 EMTN | EUR | 3.016.855,91 | 0,59 |
| 2.000.000 | EUROGRID GMBH 1.875% 10/06/2025 EMTN | EUR | 2.132.887,22 | 0,42 |
| 1.600.000 | EVONIK INDUSTRIES AG 02/09/2081 FRN | EUR | 1.602.000,00 | 0,31 |
| 640.000 | HEIDELBERGCEMENT AG 1.500% 07/02/2025 EMTN | EUR | 670.572,68 | 0,13 |
| 900.000 | HEIDELBERGCEMENT AG 2.250% 03/06/2024 EMTN | EUR | 952.001,95 | 0,19 |
| 2.565.000 | LANXESS AG ZCP 08/09/2027 EMTN | EUR | 2.528.294,41 | 0,50 |
| 1.000.000 | MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.500% 16/07/2028 EMTN | EUR | 1.020.326,27 | 0,20 |
| 5.900.000 | MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.875% 05/07/2031 EMTN | EUR | 6.158.837,72 | 1,21 |
| 1.700.000 | MERCK KGAA 09/09/2080 FRN | EUR | 1.749.037,91 | 0,34 |
| 1.500.000 | MERCK KGAA 12/12/2074 FRN | EUR | 1.636.956,69 | 0,32 |
| 3.900.000 | O2 TELEFONICA DEUTSCHLAND FINANZIERUNGS GMBH 1.750% 05/07/2025 | EUR | 4.118.507,13 | 0,81 |
| 3.200.000 | SCHAEFFLER AG 2.750% 12/10/2025 EMTN | EUR | 3.407.470,40 | 0,67 |
| 1.800.000 | SCHAEFFLER AG 3.375% 12/10/2028 EMTN | EUR | 2.016.000,00 | 0,40 |
| 1.685.000 | SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025 | EUR | 1.762.361,57 | 0,35 |
| 1.000.000 | VANTAGE TOWERS AG 0.375% 31/03/2027 EMTN | EUR | 999.598,05 | 0,20 |
| 3.884.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 0.125% 12/02/2027 EMTN | EUR | 3.829.469,73 | 0,75 |
| 170.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.375% 16/10/2023 EMTN | EUR | 175.121,90 | 0,03 |
| 500.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 1.500% 01/10/2024 EMTN | EUR | 521.856,83 | 0,10 |
| 4.650.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 3.375% 06/04/2028 EMTN | EUR | 5.474.456,72 | 1,08 |
| 1.364.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.625% 19/07/2029 EMTN | EUR | 1.356.740,21 | 0,27 |
| 1.000.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.000% 16/02/2023 EMTN | EUR | 1.016.147,82 | 0,20 |
| 600.000 | ZF FINANCE GMBH 3.000% 21/09/2025 EMTN | EUR | 631.500,00 | 0,12 |
| | | | **60.712.937,42** | **11,93** |
| | **Frankreich** | | | |
| 1.800.000 | ALSTOM SA ZCP 11/01/2029 | EUR | 1.745.596,13 | 0,34 |
| 1.000.000 | ARKEMA SA 3.125% 06/12/2023 EMTN | EUR | 1.059.005,85 | 0,21 |
| 3.100.000 | CAPGEMINI SE 2.500% 01/07/2023 | EUR | 3.229.170,24 | 0,63 |
| 600.000 | CARREFOUR SA 1.000% 17/05/2027 EMTN | EUR | 626.541,55 | 0,12 |
| 600.000 | CARREFOUR SA 1.750% 04/05/2026 EMTN | EUR | 645.127,18 | 0,13 |
| 1.700.000 | CARREFOUR SA 2.625% 15/12/2027 EMTN | EUR | 1.940.207,14 | 0,38 |
| 1.000.000 | CIE DE SAINT-GOBAIN 2.375% 04/10/2027 | EUR | 1.129.889,78 | 0,22 |
| 1.600.000 | ELO SACA 2.875% 29/01/2026 EMTN | EUR | 1.766.350,10 | 0,35 |
| 1.200.000 | ESSILORLUXOTTICA SA 0.125% 27/05/2025 EMTN | EUR | 1.213.692,74 | 0,24 |
| 2.300.000 | ESSILORLUXOTTICA SA 0.500% 05/06/2028 EMTN | EUR | 2.359.420,52 | 0,46 |
| 2.650.000 | FAURECIA SE 3.125% 15/06/2026 | EUR | 2.712.832,48 | 0,53 |
| 840.000 | FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.375% 30/10/2026 | EUR | 893.612,70 | 0,18 |
| 1.650.000 | FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.750% 30/04/2030 | EUR | 1.809.958,00 | 0,36 |
| 3.000.000 | IMERYS SA 1.500% 15/01/2027 EMTN | EUR | 3.168.571,71 | 0,62 |
| 2.600.000 | KERING SA 0.750% 13/05/2028 EMTN | EUR | 2.700.239,85 | 0,53 |
| 2.400.000 | KERING SA 1.250% 10/05/2026 EMTN | EUR | 2.542.460,76 | 0,50 |
| 1.200.000 | KERING SA 1.500% 05/04/2027 EMTN | EUR | 1.295.009,93 | 0,25 |
| 1.600.000 | ORANGE SA FRN PERP EMTN | EUR | 1.900.544,32 | 0,37 |
| 1.000.000 | ORANGE SA ZCP 04/09/2026 EMTN | EUR | 998.877,72 | 0,20 |
| 4.900.000 | ORANGE SA 1.125% 15/07/2024 EMTN | EUR | 5.070.210,37 | 1,01 |
| 1.000.000 | ORANGE SA 1.375% 20/03/2028 EMTN | EUR | 1.074.936,11 | 0,21 |
| 1.500.000 | ORANGE SA 1.625% 07/04/2032 EMTN | EUR | 1.660.519,89 | 0,33 |
| 1.700.000 | PERNOD RICARD SA 0.500% 24/10/2027 | EUR | 1.741.023,84 | 0,34 |
| 1.000.000 | PSA BANQUE FRANCE SA 0.625% 10/10/2022 EMTN | EUR | 1.009.706,66 | 0,20 |
| 1.450.000 | PSA BANQUE FRANCE SA 0.750% 19/04/2023 EMTN | EUR | 1.470.603,64 | 0,29 |
| 700.000 | SOLVAY FINANCE SACA FRN PERP | EUR | 785.106,32 | 0,15 |
| 3.300.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP | EUR | 3.308.250,00 | 0,65 |
| 500.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 516.875,00 | 0,10 |
| 2.945.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 3.015.311,76 | 0,59 |
| 5.174.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 5.453.173,78 | 1,08 |
| 190.000 | WPP FINANCE SA 2.375% 19/05/2027 EMTN | EUR | 212.245,07 | 0,04 |
| | | | **59.055.071,14** | **11,61** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 5.415.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN | EUR | 5.775.272,19 | 1,13 |
| 3.816.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031 | EUR | 3.845.576,86 | 0,76 |
| 1.985.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA FRN PERP | EUR | 2.076.806,25 | 0,41 |
| 790.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 23/04/2031 | EUR | 766.305,86 | 0,15 |
| 1.855.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 29/11/2026 EMTN | EUR | 1.886.675,52 | 0,37 |
| 1.045.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.625% 19/01/2033 EMTN | EUR | 1.001.463,83 | 0,20 |
| 1.222.000 | JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN | EUR | 1.435.704,69 | 0,28 |
| 1.655.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.375% 15/10/2028 | EUR | 1.664.270,73 | 0,33 |
| 2.700.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.750% 15/10/2032 | EUR | 2.717.674,15 | 0,53 |
| 1.300.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.375% 15/10/2040 | EUR | 1.317.577,09 | 0,26 |
| 1.600.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.500% 02/07/2039 | EUR | 1.668.217,76 | 0,33 |
| 2.000.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.625% 07/03/2031 | EUR | 2.199.385,78 | 0,43 |
| 3.283.000 | SES SA 1.625% 22/03/2026 EMTN | EUR | 3.483.506,57 | 0,68 |
| 600.000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN | EUR | 604.628,18 | 0,12 |
| 1.837.000 | TYCO ELECTRONICS GROUP SA ZCP 16/02/2029 | EUR | 1.784.436,69 | 0,35 |
| | | | **32.227.502,15** | **6,33** |
| | **Japan** | | | |
| 2.104.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.336% 19/04/2027 | EUR | 2.112.029,24 | 0,42 |
| 5.725.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.541% 23/10/2028 | EUR | 5.762.822,04 | 1,13 |
| 4.000.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 1.375% 09/07/2032 | EUR | 4.181.251,08 | 0,82 |
| 6.315.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.250% 21/11/2026 | EUR | 6.960.848,19 | 1,37 |
| 2.000.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030 | EUR | 2.392.429,30 | 0,47 |
| | | | **21.409.379,85** | **4,21** |
| | **Irland** | | | |
| 4.571.000 | CCEP FINANCE IRELAND DAC ZCP 06/09/2025 | EUR | 4.575.888,04 | 0,91 |
| 1.950.000 | CCEP FINANCE IRELAND DAC 0.875% 06/05/2033 | EUR | 1.939.091,60 | 0,38 |
| 1.900.000 | CRH FINANCE DAC 3.125% 03/04/2023 | EUR | 1.996.203,63 | 0,39 |
| 1.008.000 | CRH SMW FINANCE DAC 1.250% 05/11/2026 EMTN | EUR | 1.065.261,88 | 0,21 |
| 1.738.000 | FRESENIUS FINANCE IRELAND PLC 0.875% 01/10/2031 EMTN | EUR | 1.726.800,97 | 0,34 |
| 1.635.000 | KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 0.625% 20/09/2029 | EUR | 1.646.306,70 | 0,32 |
| 4.500.000 | KERRY GROUP FINANCIAL SERVICES UNLTD CO 2.375% 10/09/2025 | EUR | 4.907.993,81 | 0,96 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.820.000 | SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC 2.875% 15/01/2026 | EUR | 2.014.591,31 | 0,40 |
| 716.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 0.500% 22/09/2029 | EUR | 711.928,71 | 0,14 |
| 516.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033 | EUR | 513.162,70 | 0,10 |
| | | | **21.097.229,35** | **4,15** |
| | **Italien** | | | |
| 1.700.000 | ENEL SPA FRN PERP | EUR | 1.879.521,75 | 0,37 |
| 3.500.000 | ENEL SPA 24/05/2080 FRN | EUR | 3.809.730,16 | 0,75 |
| 977.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.125% 16/11/2023 EMTN | EUR | 980.924,23 | 0,19 |
| 4.740.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.500% 13/09/2024 EMTN | EUR | 4.805.285,25 | 0,95 |
| 1.630.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.625% 24/11/2022 EMTN | EUR | 1.644.838,05 | 0,32 |
| 2.477.000 | ITALGAS SPA 0.250% 24/06/2025 EMTN | EUR | 2.492.953,02 | 0,49 |
| 1.000.000 | ITALGAS SPA 1.000% 11/12/2031 EMTN | EUR | 1.018.640,87 | 0,20 |
| 1.300.000 | SNAM SPA 1.000% 12/09/2034 EMTN | EUR | 1.310.539,48 | 0,26 |
| 1.500.000 | SNAM SPA 1.375% 25/10/2027 EMTN | EUR | 1.593.537,89 | 0,31 |
| | | | **19.535.970,70** | **3,84** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.761.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 0.700% 12/09/2031 | EUR | 1.761.355,63 | 0,35 |
| 1.814.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 1.125% 12/04/2029 | EUR | 1.901.175,52 | 0,37 |
| 1.400.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 2.625% 06/11/2023 EMTN | EUR | 1.474.070,07 | 0,29 |
| 1.426.000 | DIAGEO FINANCE PLC 1.000% 22/04/2025 EMTN | EUR | 1.481.691,96 | 0,29 |
| 1.100.000 | FCE BANK PLC 1.615% 11/05/2023 EMTN | EUR | 1.120.847,45 | 0,22 |
| 1.900.000 | RENTOKIL INITIAL PLC 0.500% 14/10/2028 EMTN | EUR | 1.911.082,80 | 0,38 |
| 3.135.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN | EUR | 3.223.193,10 | 0,63 |
| 1.448.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.500% 02/05/2025 EMTN | GBP | 1.760.793,80 | 0,35 |
| 4.000.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.750% 27/04/2030 EMTN | GBP | 4.883.291,20 | 0,96 |
| | | | **19.517.501,53** | **3,84** |
| | **Australien** | | | |
| 1.883.000 | TELSTRA CORP LTD 1.000% 23/04/2030 | EUR | 1.963.864,72 | 0,39 |
| 2.200.000 | TELSTRA CORP LTD 3.750% 16/05/2022 EMTN | EUR | 2.256.383,47 | 0,44 |
| 5.631.000 | TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 2.280% 21/10/2027 EMTN | EUR | 6.336.885,04 | 1,25 |
| 1.955.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.750% 29/03/2028 EMTN | EUR | 2.103.582,80 | 0,41 |
| 2.000.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.875% 16/09/2024 EMTN | EUR | 2.105.965,12 | 0,41 |
| 3.500.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 3.000% 08/04/2030 EMTN | EUR | 4.119.933,69 | 0,81 |
| | | | **18.886.614,84** | **3,71** |
| | **Portugal** | | | |
| 500.000 | BRISA CONCESSAO RODOVIARIA SA 1.875% 30/04/2025 EMTN | EUR | 534.334,39 | 0,11 |
| 1.900.000 | BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.000% 22/03/2023 EMTN | EUR | 1.960.799,13 | 0,39 |
| 6.400.000 | BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN | EUR | 7.151.315,84 | 1,40 |
| 1.000.000 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 1.625% 15/04/2027 EMTN | EUR | 1.071.829,33 | 0,21 |
| 2.100.000 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 20/07/2080 FRN | EUR | 2.126.250,00 | 0,41 |
| | | | **12.844.528,69** | **2,52** |
| | **Schweden** | | | |
| 635.000 | ATLAS COPCO AB 0.625% 30/08/2026 EMTN | EUR | 655.160,53 | 0,13 |
| 3.333.000 | ESSITY AB 0.250% 08/02/2031 | EUR | 3.214.658,34 | 0,63 |
| 200.000 | ESSITY AB 0.500% 03/02/2030 | EUR | 200.008,24 | 0,04 |
| 1.700.000 | ESSITY AB 1.125% 05/03/2025 EMTN | EUR | 1.764.455,77 | 0,35 |
| 500.000 | ESSITY AB 1.125% 27/03/2024 EMTN | EUR | 514.801,57 | 0,10 |
| 200.000 | ESSITY AB 1.625% 30/03/2027 EMTN | EUR | 215.098,72 | 0,04 |
| 950.000 | SCANIA CV AB 2.250% 03/06/2025 EMTN | EUR | 1.023.573,62 | 0,20 |
| 2.389.000 | TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON 1.00% 26/05/2029 EMTN | EUR | 2.404.389,01 | 0,47 |
| | | | **9.992.145,80** | **1,96** |
| | **Belgien** | | | |
| 4.205.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 1.150% 22/01/2027 EMTN | EUR | 4.426.395,77 | 0,87 |
| 1.100.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN | EUR | 1.315.659,95 | 0,26 |
| 2.900.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.875% 02/04/2032 EMTN | EUR | 3.497.002,35 | 0,69 |
| | | | **9.239.058,07** | **1,82** |
| | **Jersey** | | | |
| 7.008.000 | APTIV PLC 1.500% 10/03/2025 | EUR | 7.321.229,36 | 1,44 |
| | | | **7.321.229,36** | **1,44** |
| | **Spanien** | | | |
| 1.500.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.069% 05/02/2024 EMTN | EUR | 1.541.433,72 | 0,30 |
| 3.200.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.460% 13/04/2026 EMTN | EUR | 3.406.560,64 | 0,67 |
| 1.300.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.528% 17/01/2025 EMTN | EUR | 1.371.700,75 | 0,27 |
| | | | **6.319.695,11** | **1,24** |
| | **Dänemark** | | | |
| 3.542.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.375% 30/06/2027 | EUR | 3.582.782,62 | 0,70 |
| 730.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.625% 09/03/2030 EMTN | EUR | 737.770,83 | 0,15 |
| | | | **4.320.553,45** | **0,85** |
| | **Finnland** | | | |
| 735.000 | METSO OUTOTEC OYJ 0.875% 26/05/2028 EMTN | EUR | 745.945,04 | 0,15 |
| 961.000 | STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN | EUR | 961.543,50 | 0,19 |
| 2.580.000 | UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN | EUR | 2.536.752,36 | 0,49 |
| | | | **4.244.240,90** | **0,83** |
| | **Bermuda** | | | |
| 3.300.000 | BACARDI LTD 2.750% 03/07/2023 | EUR | 3.458.387,39 | 0,68 |
| | | | **3.458.387,39** | **0,68** |
| | **Norwegen** | | | |
| 450.000 | NORSK HYDRO ASA 1.125% 11/04/2025 | EUR | 464.641,34 | 0,09 |
| 2.800.000 | STATNETT SF 0.875% 08/03/2025 EMTN | EUR | 2.888.005,65 | 0,57 |
| | | | **3.352.646,99** | **0,66** |
| | **Mexiko** | | | |
| 500.000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV 3.259% 22/07/2023 | EUR | 530.935,68 | 0,11 |
| 500.000 | AMERICA MOVIL SAB DE CV 4.750% 28/06/2022 | EUR | 518.647,70 | 0,10 |
| | | | **1.049.583,38** | **0,21** |
| | | | **498.357.805,40** | **97,95** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **498.357.805,40** | **97,95** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials)

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swap** | | | | | | |
| CDS MICHELIN LUXEMBOURG SCS 2.7500% 20/06/2019 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2023 | EUR | 1.050.000,00 | 20.489,34 |
| | | | | | | **20.489,34** |

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| **Zinsswaps** | | | | | |
| 0.201 | Floating | 13/03/2022 | EUR | 20.000.000,00 | 66.351,40 |
| Floating | 2.747 | 06/12/2022 | USD | 4.000.000,00 | (104.261,54) |
| | | | | | **(37.910,14)** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 7.079.383,20 | EUR | 6.093.000,00 | GBP | 31/12/2021 | 7.079.383,20 | 3.369,18 |
| 2.465.946,74 | EUR | 2.887.000,00 | USD | 31/12/2021 | 2.465.946,74 | (19.987,54) |
| | | | | | **9.545.329,94** | **(16.618,36)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| (32) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 4.317.760,00 | 23.250,00 |
| (148) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 25.133.360,00 | 298.522,10 |
| 36 | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 7.320.240,00 | (255.600,00) |
| 171 | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 19.187.055,00 | (13.680,00) |
| (44) | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 6.406.509,06 | 199.131,60 |
| (11) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 1.249.150,63 | 16.906,48 |
| (4) | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 501.315,85 | 9.787,96 |
| 12 | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 1.270.897,15 | (8.331,89) |
| | | | **65.386.287,69** | **269.986,25** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **235.947,09** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **498.357.805,40** | **97,95** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **235.947,09** | **0,05** |
| **Bankguthaben** | **7.780.880,06** | **1,53** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **2.425.846,47** | **0,47** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **508.800.479,02** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euromix Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 293.630.997,74 |
| | 30.09.2020 | EUR | 299.499.945,22 |
| | 30.09.2019 | EUR | 473.967.911,50 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 3.592,80 |
| | 30.09.2020 | EUR | 3.655,46 |
| | 30.09.2019 | EUR | 3.720,49 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 174,34 |
| | 30.09.2020 | EUR | 177,31 |
| | 30.09.2019 | EUR | 180,36 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 168,90 |
| | 30.09.2020 | EUR | 172,46 |
| | 30.09.2019 | EUR | 176,16 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 170,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | 173,79 |
| | 30.09.2019 | EUR | 177,00 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 110,34 |
| | 30.09.2020 | EUR | 112,59 |
| | 30.09.2019 | EUR | 114,93 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 165,33 |
| | 30.09.2020 | EUR | 168,98 |
| | 30.09.2019 | EUR | 172,76 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 55,13 |
| | 30.09.2020 | EUR | 56,29 |
| | 30.09.2019 | EUR | 57,49 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 55,73 |
| | 30.09.2020 | EUR | 56,74 |
| | 30.09.2019 | EUR | 57,77 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 67.906 |
| | 30.09.2020 | | 48.472 |
| | 30.09.2019 | | 64.887 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 9.381 |
| | 30.09.2020 | | 10.709 |
| | 30.09.2019 | | 65.751 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 51.042 |
| | 30.09.2020 | | 54.076 |
| | 30.09.2019 | | 63.973 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 80 |
| | 30.09.2020 | | 430 |
| | 30.09.2019 | | 488 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 318.486 |
| | 30.09.2020 | 936.632 |
| | 30.09.2019 | 1.727.381 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 12.935 |
| | 30.09.2020 | 16.600 |
| | 30.09.2019 | 35.716 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 33.523 |
| | 30.09.2020 | 44.251 |
| | 30.09.2019 | 56.799 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 4.644 |
| | 30.09.2020 | 4.644 |
| | 30.09.2019 | 23.986 |
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,45% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,85% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,55% |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 0,78% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 0,85% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (0,33%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Euromix Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **291.301.080,06** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 17.058.323,37 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 274.242.756,69 |
| **Bankguthaben** | | **96.574,34** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **1.247.509,85** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **1.622.588,86** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***294.267.753,11*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(146.654,37)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(490.101,00)** |
| Futures | | (490.101,00) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(636.755,37)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***293.630.997,74*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamtaufwendungen** | | **(2.403.922,17)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.204.272,79) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (332.806,43) |
| Abonnementsteuer | 9 | (31.432,56) |
| Bankzinsen | | (3.209,16) |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | (832.201,23) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(2.403.922,17)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 2.019.026,76 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (80.671,51) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 665.419,19 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (960.658,17) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (3.660.652,14) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (536.373,63) |
| **Ergebnis** | | **(4.957.831,67)** |
| Zeichnungen | | 82.887.856,03 |
| Rücknahmen | | (83.798.971,84) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 299.499.945,22 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***293.630.997,74*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Euromix Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Deutschland** | | | |
| 9.500.000 | BUNDESOBLIGATION ZCP 05/04/2024 | EUR | 9.672.881,95 | 3,29 |
| 1.815.000 | BUNDESOBLIGATION ZCP 07/10/2022 | EUR | 1.828.014,68 | 0,62 |
| 4.442.000 | BUNDESOBLIGATION ZCP 08/04/2022 | EUR | 4.457.831,69 | 1,52 |
| 4.000.000 | BUNDESOBLIGATION ZCP 10/10/2025 | EUR | 4.104.629,60 | 1,40 |
| 3.674.000 | BUNDESOBLIGATION ZCP 13/10/2023 | EUR | 3.729.680,79 | 1,27 |
| 10.135.000 | BUNDESOBLIGATION ZCP 14/04/2023 | EUR | 10.246.779,62 | 3,49 |
| 1.679.000 | BUNDESOBLIGATION ZCP 18/10/2024 | EUR | 1.715.275,65 | 0,58 |
| 8.306.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2026 | EUR | 8.546.889,03 | 2,91 |
| 3.660.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/11/2027 | EUR | 3.768.659,32 | 1,28 |
| 3.130.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/11/2028 | EUR | 3.220.162,87 | 1,10 |
| 9.000.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/02/2027 | EUR | 9.391.443,66 | 3,20 |
| 6.984.846 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/02/2029 | EUR | 7.327.887,99 | 2,50 |
| 5.470.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.250% 15/08/2028 | EUR | 5.732.488,73 | 1,95 |
| 12.090.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2025 | EUR | 12.582.428,00 | 4,30 |
| 10.500.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2026 | EUR | 11.022.938,01 | 3,75 |
| 8.000.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/02/2028 | EUR | 8.504.219,52 | 2,90 |
| 6.400.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 0.500% 15/08/2027 | EUR | 6.785.450,11 | 2,31 |
| 4.730.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.000% 15/08/2024 | EUR | 4.964.750,23 | 1,69 |
| 8.200.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.000% 15/08/2025 | EUR | 8.733.009,10 | 2,97 |
| 7.251.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 04/09/2022 | EUR | 7.400.274,60 | 2,52 |
| 12.000.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 15/02/2023 | EUR | 12.369.092,40 | 4,22 |
| 7.773.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 15/05/2023 | EUR | 8.054.446,88 | 2,74 |
| 7.500.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 15/05/2024 | EUR | 7.939.938,53 | 2,70 |
| 11.650.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.750% 04/07/2022 | EUR | 11.866.714,93 | 4,05 |
| 5.583.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.750% 15/02/2024 | EUR | 5.915.900,44 | 2,01 |
| 6.680.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 2.000% 04/01/2022 | EUR | 6.726.603,69 | 2,29 |
| 7.200.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 2.000% 15/08/2023 | EUR | 7.572.440,38 | 2,58 |
| 3.620.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 4.750% 04/07/2028 | EUR | 4.918.728,79 | 1,68 |
| 5.770.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 6.250% 04/01/2024 | EUR | 6.685.944,80 | 2,28 |
| 5.000.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 6.500% 04/07/2027 | EUR | 7.061.657,75 | 2,40 |
| 5.330.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND 5.625% 04/01/2028 | EUR | 7.412.824,57 | 2,52 |
| | | | **220.259.988,31** | **75,02** |
| | **Niederlande** | | | |
| 5.100.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2024 | EUR | 5.181.011,82 | 1,75 |
| 4.400.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/01/2027 | EUR | 4.508.296,45 | 1,54 |
| 3.220.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2030 | EUR | 3.265.300,89 | 1,11 |
| 2.760.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2031 | EUR | 2.781.214,82 | 0,95 |
| 4.400.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.250% 15/07/2025 | EUR | 4.543.740,04 | 1,55 |
| 3.100.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.250% 15/07/2029 | EUR | 3.219.581,07 | 1,10 |
| 6.321.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/07/2026 | EUR | 6.638.471,53 | 2,25 |
| 4.500.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.750% 15/07/2027 | EUR | 4.814.643,74 | 1,64 |
| 4.000.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.750% 15/07/2028 | EUR | 4.303.289,60 | 1,47 |
| 3.000.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.000% 15/07/2024 | EUR | 3.226.006,68 | 1,10 |
| 2.950.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.250% 15/07/2022 | EUR | 3.018.251,88 | 1,03 |
| 2.576.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 3.750% 15/01/2023 | EUR | 2.725.041,56 | 0,93 |
| 770.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 5.500% 15/01/2028 | EUR | 1.059.129,49 | 0,36 |
| 4.247.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 7.500% 15/01/2023 | EUR | 4.698.788,81 | 1,60 |
| | | | **53.982.768,38** | **18,38** |
| | | | **274.242.756,69** | **93,40** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 17.218 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 17.058.323,37 | 5,81 |
| | | | **17.058.323,37** | **5,81** |
| | | | **17.058.323,37** | **5,81** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **291.301.080,06** | **99,21** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| 58 | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 7.825.940,00 | (46.400,00) |
| 242 | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 41.096.440,00 | (457.216,00) |
| (159) | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 17.840.595,00 | 13.515,00 |
| | | | **66.762.975,00** | **(490.101,00)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(490.101,00)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **291.301.080,06** | **99,21** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(490.101,00)** | **(0,17)** |
| **Bankguthaben** | **96.574,34** | **0,03** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **2.723.444,34** | **0,93** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **293.630.997,74** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European ABS

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 266.634.309,02 |
| | 30.09.2020 | EUR | 247.264.205,01 |
| | 30.09.2019 | EUR | 248.716.946,33 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.273,51 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.133,48 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.170,59 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 26,16 |
| | 30.09.2020 | EUR | 25,43 |
| | 30.09.2019 | EUR | 25,58 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.469,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.301,87 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.317,29 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 648 |
| | 30.09.2020 | | 614 |
| | 30.09.2019 | | 735 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 4.807.329 |
| | 30.09.2020 | | 3.896.641 |
| | 30.09.2019 | | 3.693.627 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 25.129 |
| | 30.09.2020 | | 27.353 |
| | 30.09.2019 | | 28.293 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,49% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 0,35% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,06% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 79,99% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European ABS

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **277.029.756,93** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 2.900.464,46 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 274.129.292,47 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **2.181,20** |
| Devisentermingeschäfte | | 2.181,20 |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **11.996.711,45** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***289.028.649,58*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(243.039,79)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(22.151.300,77)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(22.394.340,56)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***266.634.309,02*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **4.095.507,77** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 4.095.507,77 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(510.220,12)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (182.968,59) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (246.054,11) |
| Abonnementsteuer | 9 | (70.017,58) |
| Bankzinsen | | (11.179,84) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **3.585.287,65** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 1.137.299,97 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.248.627,60) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 3.800.720,28 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (6.768.482,33) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 314.730,57 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (226.417,52) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 7.565.672,04 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (9.869,85) |
| **Ergebnis** | | **8.150.313,21** |
| Zeichnungen | | 29.332.223,75 |
| Rücknahmen | | (18.112.432,95) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 247.264.205,01 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***266.634.309,02*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European ABS

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Irland** | | | |
| 2.815.000 | ARBOUR CLO VIII DAC -8X C 15/07/2033 FRN | EUR | 2.815.972,86 | 1,06 |
| 2.000.000 | CAIRN CLO V DAC 2015-5X CR 20/07/2030 FRN | EUR | 2.000.224,80 | 0,75 |
| 1.730.000 | CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2020-1 D 15/12/2029 FRN | EUR | 1.798.791,62 | 0,67 |
| 3.290.677 | DILOSK RMBS -3 B 20/10/2057 FRN | EUR | 3.297.487,66 | 1,24 |
| 900.000 | DUNEDIN PARK CLO DAC -1X B1 22/10/2032 FRN | EUR | 900.285,75 | 0,34 |
| 3.280.000 | FAIR OAKS LOAN FUNDING III DAC -3X C 15/10/2033 FRN | EUR | 3.271.576,96 | 1,23 |
| 1.458.000 | FASTNET SECURITIES 13 DAC - 13 C 18/04/2057 FRN | EUR | 1.461.029,04 | 0,55 |
| 4.750.000 | FASTNET SECURITIES 13 DAC -13 D 18/04/2057 FRN | EUR | 4.756.650,38 | 1,78 |
| 1.750.000 | FINANCE IRELAND RMBS NO 3 DAC 3 D 24/06/2061 FRN | EUR | 1.749.633,95 | 0,66 |
| 3.400.000 | FINANCE IRELAND RMBS -1 B 24/06/2058 FRN | EUR | 3.413.678,37 | 1,28 |
| 2.464.000 | FINANCE IRELAND RMBS -1 C 24/06/2058 FRN | EUR | 2.473.032,83 | 0,93 |
| 3.168.000 | FINANCE IRELAND RMBS -1 D 24/06/2058 FRN | EUR | 3.178.725,01 | 1,19 |
| 4.500.000 | FORTUNA CONSUMER LOAN ABS 2021 DAC 2021 C 15/10/2030 FRN | EUR | 4.500.000,00 | 1,69 |
| 4.559.564 | GLENBEIGH 2 ISSUER DAC -1X A 24/03/2046 FRN | EUR | 4.562.554,63 | 1,71 |
| 3.200.000 | GLENBEIGH 2 ISSUER 2021-2 DAC 2021-2X A 24/12/2024 FRN | EUR | 3.218.055,90 | 1,21 |
| 1.576.179 | GRAND CANAL SECURITIES -2 A 24/12/2058 FRN | EUR | 1.576.467,78 | 0,59 |
| 650.000 | HARVEST CLO IX DAC-9X CR 15/02/2030 FRN | EUR | 636.220,72 | 0,24 |
| 600.000 | HAUS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 39 DAC 39X C 28/06/2026 FRN | EUR | 599.294,78 | 0,22 |
| 600.000 | HAUS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 39 DAC 39X D 28/06/2026 FRN | EUR | 599.201,51 | 0,22 |
| 2.850.000 | HAYFIN EMERALD CLO III DAC -3X C 15/10/2032 FRN | EUR | 2.850.974,70 | 1,07 |
| 5.000.000 | HENLEY CLO III DAC -3X A 25/01/2034 FRN | EUR | 5.005.241,50 | 1,88 |
| 5.000.000 | INVESCO EURO CLO V DAC -5X D 15/01/2034 FRN | EUR | 5.037.500,00 | 1,89 |
| 2.480.000 | MULCAIR SECURITIES DAC -1 B 24/04/2071 FRN | EUR | 2.486.180,66 | 0,93 |
| 2.480.000 | MULCAIR SECURITIES DAC -1 C 24/04/2071 FRN | EUR | 2.482.966,58 | 0,93 |
| 2.000.000 | NORTHWOODS CAPITAL 19 EURO DAC 2019-19X B1 25/11/2033 FRN | EUR | 2.003.015,40 | 0,75 |
| 2.000.000 | NORTHWOODS CAPITAL 19 EURO DAC 2019-19X D 25/11/2033 FRN | EUR | 2.004.871,80 | 0,75 |
| 2.000.000 | OCP EURO CLO 2017-2X B DAC 15/01/2032 FRN | EUR | 1.992.039,60 | 0,75 |
| 0,04 | ORANJE EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 32 DAC - 32 A 22/11/2028 FRN | EUR | 0,04 | 0,00 |
| 2.147.298 | ORANJE EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 32 DAC - 32 C 22/11/2028 FRN | EUR | 2.151.960,57 | 0,81 |
| 2.000.000 | PALMER SQUARE EUROPEAN LOAN FUNDING 2020-1A B 15/01/2030 FRN | EUR | 2.001.402,80 | 0,75 |
| 821.655 | PEMBROKE PROPERTY FINANCE DAC -1 A 01/06/2037 FRN | EUR | 822.646,47 | 0,31 |
| 1.500.000 | PEPPER IBERIA UNSECURED 2019 DAC 2019-1 C 07/04/2028 FRN | EUR | 1.503.252,50 | 0,56 |
| 4.705.433 | PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 A 24/03/2061 FRN | EUR | 4.709.752,25 | 1,77 |
| 3.024.000 | PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 C 24/03/2061 FRN | EUR | 3.032.946,23 | 1,14 |
| 1.286.000 | PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 D 24/03/2061 FRN | EUR | 1.288.258,22 | 0,48 |
| 1.632.100 | TAURUS DAC -2019-1FR C 02/02/2031 FRN | EUR | 1.638.707,35 | 0,61 |
| 2.700.000 | TAURUS 2019-4 FIN DAC 2019-FIN4 B 18/11/2031 FRN | EUR | 2.686.763,39 | 1,01 |
| 3.100.000 | TORO EUROPEAN CLO 4 DAC -1X CRE 15/07/2030 FRN | EUR | 3.100.000,00 | 1,16 |
| | | | **93.607.364,61** | **35,11** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.485.000 | ATLAS FUNDING 2021-1 PLC 2021-1 B 25/07/2058 FRN | GBP | 1.747.226,11 | 0,66 |
| 2.881.000 | CASTELL PLC -2020-1 B 25/09/2052 FRN | GBP | 3.418.281,62 | 1,28 |
| 1.720.000 | CASTELL 2020-1 PLC -2020-1 C 25/09/2052 FRN | GBP | 2.038.582,17 | 0,76 |
| 3.990.000 | CHESTER B1 ISSUER PLC B1 C 17/04/2023 FRN | GBP | 4.652.987,59 | 1,75 |
| 2.997.000 | CHESTER B1 ISSUER PLC B1 D 17/04/2023 FRN | GBP | 3.481.452,46 | 1,31 |
| 2.644.000 | CMF 2020-1 PLC 2020-1 D 16/03/2024 FRN | GBP | 3.068.356,10 | 1,15 |
| 6.965.770 | EUROSAIL 2006-3NC PLC 2006-3X B1A 10/09/2044 FRN | EUR | 6.924.407,01 | 2,60 |
| 1.848.991 | GENESIS MORTGAGE FUNDING 2019-1 PLC 2019-1 D 1.600% 22/01/2033 FRN | GBP | 2.168.425,01 | 0,81 |
| 3.386.983 | GENESIS MORTGAGE FUNDING 2019-1 PLC 2019-1 E 15/06/2056 FRN | GBP | 3.933.681,07 | 1,48 |
| 3.866.467 | GRIFONAS FINANCE NO 1 PLC A 28/08/2039 FRN | EUR | 3.771.972,88 | 1,41 |
| 2.899.885 | HOPS HILL NO 1 PLC -1 C 27/05/2054 FRN | GBP | 3.409.036,83 | 1,28 |
| 1.499.962 | HOPS HILL NO 1 PLC -1 D 27/05/2054 FRN | GBP | 1.763.930,34 | 0,66 |
| 1.230.000 | LANEBROOK MORTGAGE TRANSACTION 2021 2021-1 D 20/07/2058 FRN | GBP | 1.433.310,25 | 0,54 |
| 1.000.000 | LONDON WALL MORTGAGE CAPITAL PLC 2016-FL1 C 15/08/2048 FRN | GBP | 1.167.007,02 | 0,44 |
| 1.739.830 | LONDON WALL MORTGAGE CAPITAL PLC 2018-FL1 C 15/05/2050 FRN | GBP | 2.022.041,35 | 0,76 |
| 621.368 | LONDON WALL MORTGAGE CAPITAL PLC 2018-FL1 D 15/05/2050 FRN | GBP | 724.566,45 | 0,27 |
| 952.000 | NEWDAY FUNDING 2019-2 PLC 2019-2X D 15/09/2027 FRN | GBP | 1.122.889,97 | 0,42 |
| 3.250.000 | PRECISE MORTGAGE FUNDING PLC -2019-1B D 12/12/2055 FRN | GBP | 3.878.421,43 | 1,45 |
| 1.380.000 | PRECISE MORTGAGE FUNDING 2018-1B PLC 2018-1B C 12/12/2054 FRN | GBP | 1.608.908,81 | 0,60 |
| 2.000.000 | RESIDENTIAL MORTGAGE SECURITIES PLC -32X D 20/06/2070 FRN | GBP | 2.376.169,37 | 0,89 |
| 1.063.402 | RMAC SECURITIES NO 1 PLC 2006-NS1X B1C 16/08/2005 FRN | EUR | 1.040.265,18 | 0,39 |
| 3.333.172 | RMAC SECURITIES NO 1 PLC 2006-NS2X M1C 12/06/2044 FRN | EUR | 3.199.347,46 | 1,20 |
| 2.004.104 | RMAC SECURITIES PLC -2006-NS1X M1C 12/06/2044 FRN | EUR | 1.930.881,25 | 0,72 |
| 3.150.000 | STRATTON MORTGAGE FUNDING 2021-3 PLC 2021-3 C 12/06/2024 FRN | GBP | 3.677.900,80 | 1,38 |
| 1.300.000 | STRATTON MORTGAGE FUNDING 2021-3 PLC 2021-3 D 12/06/2024 FRN | GBP | 1.513.787,44 | 0,57 |
| 2.563.132 | TOWD POINT MORTGAGE FUNDING PLC -2019-V2X A 20/02/2054 FRN | GBP | 2.996.054,22 | 1,12 |
| 2.000.000 | TOWD POINT MORTGAGE FUNDING 2019 - GRANITE4 D PLC 20/10/2051 FRN | GBP | 2.328.067,13 | 0,87 |
| 2.465.065 | TRINIDAD MORTGAGE SECURITIES 2018-1 PLC 2018-1 D 24/01/2059 FRN | GBP | 2.865.639,09 | 1,07 |
| 1.098.000 | TUDOR ROSE MORTGAGES 2020-1 PLC -2020-1 D 20/06/2048 FRN | GBP | 1.282.087,46 | 0,48 |
| 2.400.000 | TWIN BRIDGES PLC 2017-1 C 12/09/2044 FRN | GBP | 2.805.804,20 | 1,05 |
| 2.500.000 | TWIN BRIDGES 2019-2 PLC 2019-2 D 12/09/2044 FRN | GBP | 2.939.158,14 | 1,10 |
| 2.745.000 | TWIN BRIDGES 2021-1 PLC 2021-1 D 12/03/2026 FRN | GBP | 3.250.304,28 | 1,22 |
| 2.350.000 | TWIN BRIDGES 2021-2 PLC 2021-2 D 12/09/2026 FRN | GBP | 2.734.032,38 | 1,03 |
| | | | **87.274.982,87** | **32,72** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 3.500.000 | CARTESIAN RESIDENTIAL MORTAGAGES -4 C 25/11/2054 FRN | EUR | 3.531.796,73 | 1,32 |
| 1.750.000 | CARTESIAN RESIDENTIAL MORTGAGES -4 D 25/11/2054 FRN | EUR | 1.770.133,30 | 0,66 |
| 3.489.101 | MIRAVET SARL - COMPARTMENT 2020-1 2020-1 A 26/05/2065 FRN | EUR | 3.497.477,84 | 1,31 |
| 1.000.000 | MIRAVET SARL - COMPARTMENT 2020-1 2020-1 B 26/05/2065 FRN | EUR | 989.289,25 | 0,37 |
| 2.023.157 | MIRAVET SARL 2019-1 A 26/05/2065 FRN | EUR | 2.025.368,69 | 0,76 |
| 4.200.000 | MIRAVET SARL 2019-1 B 26/05/2065 FRN | EUR | 4.157.430,19 | 1,57 |
| 2.200.000 | SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2020-1 2020-1 C 14/11/2031 FRN | EUR | 2.221.127,35 | 0,83 |
| 1.600.000 | SC GERMANY SA COMPARTMENT CONSUMER 2020-1 2020-1 D 14/11/2031 FRN | EUR | 1.622.211,62 | 0,61 |
| 3.700.000 | SILVER ARROW S.A. COMPARTMENT -10 D 15/03/2027 FRN | EUR | 3.733.373,78 | 1,40 |
| | | | **23.548.208,75** | **8,83** |
| | **Spanien** | | | |
| 4.825.629 | AUTONORIA SPAIN 2019-SP D 25/12/2035 FRN | EUR | 4.868.906,89 | 1,83 |
| 5.000.000 | AUTONORIA SPAIN 2021 FT 2021-SP D 31/01/2039 FRN | EUR | 5.012.379,90 | 1,88 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European ABS

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.801.788 | FT SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO -2020-1 C 20/03/2033 FRN | EUR | 2.811.618,13 | 1,05 |
| 4.600.000 | FTA SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2021-1 2021-1 C 22/06/2035 FRN | EUR | 4.533.029,57 | 1,70 |
| 2.422.774 | SABADELL CONSUMO FDT -1 B 24/03/2031 FRN | EUR | 2.427.095,54 | 0,91 |
| | | | **19.653.030,03** | **7,37** |
| | **Italien** | | | |
| 1.780.206 | ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACT 17 C 15/04/2032 FRN | EUR | 1.792.896,09 | 0,67 |
| 1.772.989 | AUTOFLORANCE -1 C 25/12/2042 FRN | EUR | 1.791.199,29 | 0,67 |
| 2.176.497 | AUTOFLORENCE -1 D 25/12/2042 FRN | EUR | 2.210.946,01 | 0,83 |
| 3.400.000 | AUTOFLORENCE 2 SRL 2 C 21/12/2044 FRN | EUR | 3.401.814,95 | 1,28 |
| 2.700.000 | CORDUSIO RMBS 3 D - UBCASA 1 SRL -3 D 31/12/2042 FRN | EUR | 2.664.642,61 | 1,00 |
| 4.704.637 | PELMO SRL 1 A 15/12/2036 FRN | EUR | 4.743.962,50 | 1,78 |
| | | | **16.605.461,45** | **6,23** |
| | **Frankreich** | | | |
| 3.800.000 | CFHL-1 2014 2014-1 D 28/04/2054 FRN | EUR | 3.814.852,72 | 1,43 |
| 1.500.000 | CFHL-1 2014 28/04/2054 FRN | EUR | 1.510.406,24 | 0,57 |
| 3.658.141 | E-CARAT SA 10FR D 20/12/2028 FRN | EUR | 3.656.150,87 | 1,37 |
| 3.476.874 | FCT AUTONORIA -2019-1 D 25/09/2035 FRN | EUR | 3.491.615,88 | 1,31 |
| 2.000.000 | FCT NORIA 2021 2021-1 D 25/10/2049 FRN | EUR | 1.998.928,50 | 0,75 |
| | | | **14.471.954,21** | **5,43** |
| | **Niederlande** | | | |
| 2.500.000 | DRYDEN 51 EURO CLO 2017 BV 2017-51X C 15/07/2031 FRN | EUR | 2.500.397,50 | 0,94 |
| 2.500.000 | DUTCH PROPERTY FINANCE BV -2020-1 D 28/07/2054 FRN | EUR | 2.539.917,68 | 0,94 |
| 2.375.000 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2020-1 BV 2020-1 D 28/07/2054 FRN | EUR | 2.380.571,56 | 0,89 |
| 2.339.000 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2021-1 BV 2021-1 D 28/07/2058 FRN | EUR | 2.366.913,06 | 0,89 |
| 849.815 | E-MAC DE 2006-II BV DE06-II B 25/02/2058 FRN | EUR | 840.144,97 | 0,32 |
| 1.380.000 | JUBILEE CLO 2015-XV BV 2015-15X DR 12/07/2028 FRN | EUR | 1.375.641,82 | 0,52 |
| 416.479 | MAGOI 2019 BV 2019-1 D 27/07/2039 FRN | EUR | 417.220,87 | 0,16 |
| 416.479 | MAGOI 2019 BV 2019-1 E 27/07/2039 FRN | EUR | 418.462,00 | 0,16 |
| | | | **12.839.269,46** | **4,82** |
| | **Deutschland** | | | |
| 1.656.353 | RED & BLACK AUTO GERMANY 6 UG 6 C 15/10/2028 FRN | EUR | 1.659.292,80 | 0,62 |
| 2.400.000 | RED & BLACK AUTO GERMANY 7 UG 7 D 15/11/2024 FRN | EUR | 2.469.293,47 | 0,93 |
| 2.000.000 | RED & BLACK AUTO GERMANY 8 UG 15/09/2030 FRN | EUR | 2.000.434,82 | 0,75 |
| | | | **6.129.021,09** | **2,30** |
| | | | **274.129.292,47** | **102,81** |
| | **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | |
| | **Offene Fonds** | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 2.928 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 2.900.464,46 | 1,09 |
| | | | **2.900.464,46** | **1,09** |
| | | | **2.900.464,46** | **1,09** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **277.029.756,93** | **103,90** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | **Devisentermingeschäfte** | | |
| 1.561.699,15 | GBP | 1.812.569,67 | EUR | 29/10/2021 | 1.812.569,67 | 3.524,29 |
| 72.184.273,75 | EUR | 62.074.000,00 | GBP | 29/10/2021 | 72.184.273,75 | (1.343,09) |
| | | | | | **73.996.843,42** | **2.181,20** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **2.181,20** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **277.029.756,93** | **103,90** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **2.181,20** | **0,00** |
| **Bankverbindlichkeiten** | **(243.039,79)** | **(0,09)** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(10.154.589,32)** | **(3,81)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **266.634.309,02** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 137.376.357,52 |
| | 30.09.2020 | EUR | 23.794.410,91 |
| | 30.09.2019 | | - |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.209,77 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.745,34 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 308,29 |
| | 30.09.2020 | EUR | 236,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 309,94 |
| | 30.09.2020 | EUR | 237,00 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 263,58 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.083,98 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.749,19 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 16.938 |
| | 30.09.2020 | | 7 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 5.353 |
| | 30.09.2020 | | 29 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 9 |
| | 30.09.2020 | | 29 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 473 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | | 5.000 |
| | 30.09.2020 | | 5.000 |
| | 30.09.2019 | | - |
| **Dividende** | | | |
| Distribution Z (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 112,70 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,19% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 0,55% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 0,28% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 1,05% |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,11% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 45,50% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **136.922.215,85** |
| Aktien | | 136.922.215,85 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **16.707,14** |
| Optionsscheine und Bezugsrechte | | 16.707,14 |
| **Bankguthaben** | | **455.063,94** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **246.693,28** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***137.640.680,21*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(264.322,69)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(264.322,69)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***137.376.357,52*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **3.113.787,11** |
| Dividenden | | 3.113.787,11 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(183.853,01)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (65.093,11) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (103.034,95) |
| Abonnementsteuer | 9 | (12.711,27) |
| Bankzinsen | | (2.351,72) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (661,96) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **2.929.934,10** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 6.149.040,41 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (719.498,85) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 784,10 |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 234.504,66 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (261.143,33) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 15.066.527,23 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 16.707,14 |
| **Ergebnis** | | **23.416.855,46** |
| Zeichnungen | | 119.160.802,70 |
| Rücknahmen | | (28.432.211,55) |
| Ausschüttung | | (563.500,00) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 23.794.410,91 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***137.376.357,52*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 62.439 | ABRDN PLC | GBP | 185.675,54 | 0,14 |
| 9.263 | ASHTEAD GROUP PLC | GBP | 608.457,79 | 0,44 |
| 26.119 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 2.722.109,04 | 1,98 |
| 2.445 | AVEVA GROUP PLC | GBP | 102.404,56 | 0,07 |
| 111.593 | AVIVA PLC | GBP | 513.996,75 | 0,37 |
| 334.423 | BARCLAYS PLC | GBP | 737.687,44 | 0,54 |
| 24.228 | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | GBP | 186.149,78 | 0,14 |
| 3.225 | BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC | GBP | 163.664,05 | 0,12 |
| 586.822 | BP PLC | GBP | 2.323.305,13 | 1,69 |
| 28.201 | BRITISH LAND CO PLC/THE | GBP | 162.473,69 | 0,12 |
| 171.974 | BT GROUP PLC | GBP | 319.725,65 | 0,23 |
| 5.365 | BUNZL PLC | GBP | 153.235,41 | 0,11 |
| 8.534 | BURBERRY GROUP PLC | GBP | 180.205,14 | 0,13 |
| 6.791 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | USD | 323.978,07 | 0,24 |
| 42.394 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 751.670,10 | 0,55 |
| 45.326 | DIAGEO PLC | GBP | 1.901.564,37 | 1,38 |
| 125.080 | GLAXOSMITHKLINE PLC | GBP | 2.042.533,30 | 1,49 |
| 1.572 | HALMA PLC | GBP | 51.977,40 | 0,04 |
| 1.762 | HARGREAVES LANSDOWN PLC | GBP | 29.345,07 | 0,02 |
| 338.160 | HSBC HOLDINGS PLC | GBP | 1.534.547,84 | 1,12 |
| 44.652 | INFORMA PLC | GBP | 285.408,89 | 0,21 |
| 9.013 | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | GBP | 498.711,21 | 0,36 |
| 2.453 | INTERTEK GROUP PLC | GBP | 142.037,53 | 0,10 |
| 40.262 | J SAINSBURY PLC | GBP | 133.686,40 | 0,10 |
| 10.432 | JD SPORTS FASHION PLC | GBP | 127.254,73 | 0,09 |
| 11.827 | JOHNSON MATTHEY PLC | GBP | 369.450,96 | 0,27 |
| 42.852 | KINGFISHER PLC | GBP | 167.762,19 | 0,12 |
| 23.183 | LAND SECURITIES GROUP PLC | GBP | 187.992,42 | 0,14 |
| 166.168 | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | GBP | 543.433,18 | 0,40 |
| 1.567.273 | LLOYDS BANKING GROUP PLC | GBP | 849.158,59 | 0,63 |
| 5.150 | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | GBP | 446.376,60 | 0,32 |
| 71.114 | M&G PLC | GBP | 168.449,91 | 0,12 |
| 25.706 | MONDI PLC | GBP | 547.148,02 | 0,40 |
| 153.296 | NATWEST GROUP PLC | GBP | 401.105,10 | 0,29 |
| 2.505 | NEXT PLC | GBP | 239.328,59 | 0,17 |
| 662 | NMC HEALTH PLC | GBP | 7.227,43 | 0,01 |
| 13.416 | PEARSON PLC | GBP | 111.101,25 | 0,08 |
| 6.669 | PERSIMMON PLC | GBP | 207.006,73 | 0,15 |
| 7.966 | PHOENIX GROUP HOLDINGS PLC | GBP | 59.833,14 | 0,04 |
| 48.377 | PRUDENTIAL PLC | GBP | 818.916,91 | 0,60 |
| 11.666 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | GBP | 791.276,82 | 0,58 |
| 34.190 | RELX PLC | GBP | 854.022,00 | 0,62 |
| 32.427 | RENTOKIL INITIAL PLC | GBP | 220.170,92 | 0,16 |
| 16.782 | SAGE GROUP PLC/THE | GBP | 138.546,40 | 0,10 |
| 330 | SCHRODERS PLC | GBP | 13.802,28 | 0,01 |
| 11.591 | SEGRO PLC | GBP | 161.148,67 | 0,12 |
| 22.204 | SMITH & NEPHEW PLC | GBP | 332.466,34 | 0,24 |
| 668 | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | GBP | 116.341,91 | 0,08 |
| 4.252 | ST JAMES'S PLACE PLC | GBP | 74.549,45 | 0,05 |
| 48.681 | STANDARD CHARTERED PLC | GBP | 246.935,71 | 0,18 |
| 90.703 | TAYLOR WIMPEY PLC | GBP | 164.409,54 | 0,12 |
| 201.827 | TESCO PLC | GBP | 594.774,54 | 0,43 |
| 43.650 | UNILEVER PLC | GBP | 2.033.876,99 | 1,48 |
| 55.222 | UNITED UTILITIES GROUP PLC | GBP | 622.163,93 | 0,45 |
| 550.721 | VODAFONE GROUP PLC | GBP | 725.937,88 | 0,53 |
| 40.219 | WM MORRISON SUPERMARKETS PLC | GBP | 137.801,68 | 0,10 |
| 18.164 | 3I GROUP PLC | GBP | 270.812,07 | 0,20 |
| | | | **28.805.133,03** | **20,97** |
| | **Frankreich** | | | |
| 1.402 | AEROPORTS DE PARIS | EUR | 155.061,20 | 0,11 |
| 5.954 | ALSTOM SA | EUR | 195.588,90 | 0,14 |
| 4.227 | ARKEMA SA | EUR | 483.991,50 | 0,35 |
| 3.475 | ATOS SE | EUR | 160.371,25 | 0,12 |
| 37.901 | AXA SA | EUR | 912.845,59 | 0,67 |
| 939 | BIOMERIEUX | EUR | 92.547,84 | 0,07 |
| 22.896 | BNP PARIBAS SA | EUR | 1.269.354,24 | 0,92 |
| 2.532 | BUREAU VERITAS SA | EUR | 67.629,72 | 0,05 |
| 3.000 | CAPGEMINI SE | EUR | 540.450,00 | 0,39 |
| 13.464 | CARREFOUR SA | EUR | 209.297,88 | 0,15 |
| 4.226 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA | EUR | 561.212,80 | 0,41 |
| 11.073 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 644.891,52 | 0,47 |
| 1.773 | COVIVIO | EUR | 129.109,86 | 0,09 |
| 21.377 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 255.369,64 | 0,19 |
| 13.437 | DANONE SA | EUR | 793.454,85 | 0,58 |
| 3.031 | EDENRED | EUR | 141.335,53 | 0,10 |
| 2.420 | EIFFAGE SA | EUR | 212.185,60 | 0,15 |
| 5.078 | ESSILORLUXOTTICA SA | EUR | 840.409,00 | 0,61 |
| 1.752 | GECINA SA | EUR | 204.195,60 | 0,15 |
| 14.247 | GETLINK SE | EUR | 192.833,15 | 0,14 |
| 509 | HERMES INTERNATIONAL | EUR | 609.018,50 | 0,44 |
| 181 | ILIAD SA | EUR | 32.942,00 | 0,02 |
| 2.028 | IPSEN SA | EUR | 167.431,68 | 0,12 |
| 1.198 | KERING SA | EUR | 737.968,00 | 0,54 |
| 4.309 | KLEPIERRE SA | EUR | 83.766,96 | 0,06 |
| 4.487 | LEGRAND SA | EUR | 416.214,12 | 0,30 |
| 4.290 | L'OREAL SA | EUR | 1.530.886,50 | 1,11 |
| 4.384 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 2.718.518,40 | 1,98 |
| 30.139 | ORANGE SA | EUR | 281.859,93 | 0,22 |
| 978 | ORPEA | EUR | 98.484,60 | 0,07 |
| 4.789 | PERNOD RICARD SA | EUR | 913.262,30 | 0,66 |
| 4.149 | PUBLICIS GROUPE SA | EUR | 241.720,74 | 0,18 |
| 10.974 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 1.579.158,60 | 1,15 |
| 278 | SEB SA | EUR | 33.888,20 | 0,02 |
| 22.556 | SOCIETE GENERALE SA | EUR | 613.410,42 | 0,45 |
| 3.606 | SODEXO SA | EUR | 273.262,68 | 0,20 |
| 21.603 | SUEZ SA | EUR | 425.255,06 | 0,31 |
| 737 | TELEPERFORMANCE | EUR | 250.653,70 | 0,18 |
| 47.419 | TOTALENERGIES SE | EUR | 1.960.064,37 | 1,44 |
| 1.375 | UBISOFT ENTERTAINMENT SA | EUR | 71.335,00 | 0,05 |
| 5.340 | VALEO | EUR | 129.495,00 | 0,09 |
| 23.269 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA | EUR | 615.697,74 | 0,45 |
| 10.643 | VINCI SA | EUR | 959.466,45 | 0,70 |
| 3.954 | WORLDLINE SA/FRANCE | EUR | 261.003,54 | 0,19 |
| | | | **23.066.900,16** | **16,79** |
| | **Schweiz** | | | |
| 44.052 | ABB LTD - REG | CHF | 1.279.029,09 | 0,93 |
| 3.859 | ADECCO GROUP AG - REG | CHF | 167.834,36 | 0,12 |
| 10.367 | ALCON INC | CHF | 729.153,03 | 0,53 |
| 465 | BALOISE HOLDING AG | CHF | 61.204,21 | 0,04 |
| 148 | BARRY CALLEBAUT AG - REG | CHF | 290.215,80 | 0,21 |
| 9.622 | CIE FINANCIERE RICHEMONT SA - REG | CHF | 867.035,65 | 0,63 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 7.690 | COCA-COLA HBC AG -DI | GBP | 214.632,01 | 0,16 |
| 502 | GEBERIT AG - REG | CHF | 319.923,70 | 0,23 |
| 286 | GIVAUDAN SA - REG | CHF | 1.127.464,70 | 0,82 |
| 1.572 | LOGITECH INTERNATIONAL SA - REG | CHF | 121.063,28 | 0,09 |
| 51.352 | NESTLE SA - REG | CHF | 5.353.092,57 | 3,91 |
| 257 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 348.609,06 | 0,25 |
| 12.906 | ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN | CHF | 4.082.044,59 | 2,97 |
| 1.185 | SCHINDLER HOLDING AG - REG | CHF | 264.593,45 | 0,19 |
| 65 | SGS SA - REG | CHF | 163.893,86 | 0,12 |
| 4.606 | SIKA AG - REG | CHF | 1.264.478,08 | 0,92 |
| 1.201 | SONOVA HOLDING AG - REG | CHF | 394.583,97 | 0,29 |
| 268 | STRAUMANN HOLDING AG - REG | CHF | 417.322,11 | 0,30 |
| 769 | SWISS LIFE HOLDING AG - REG | CHF | 336.798,23 | 0,25 |
| 6.501 | SWISS RE AG | CHF | 481.895,62 | 0,35 |
| 177 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 87.982,12 | 0,06 |
| 1.497 | TEMENOS AG - REG | CHF | 175.991,15 | 0,13 |
| 75.566 | UBS GROUP AG - REG | CHF | 1.048.434,17 | 0,77 |
| 3.441 | VIFOR PHARMA AG | CHF | 386.709,13 | 0,28 |
| 2.527 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 896.617,72 | 0,65 |
| | | | **20.880.601,66** | **15,20** |
| | **Deutschland** | | | |
| 3.177 | ADIDAS AG | EUR | 863.508,60 | 0,63 |
| 8.040 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 1.566.513,60 | 1,14 |
| 4.079 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 337.578,04 | 0,25 |
| 2.013 | BECHTLE AG | EUR | 119.370,90 | 0,09 |
| 2.983 | BEIERSDORF AG | EUR | 278.791,18 | 0,20 |
| 4.369 | BRENNTAG SE | EUR | 352.054,02 | 0,26 |
| 33.023 | COMMERZBANK AG | EUR | 190.047,37 | 0,14 |
| 10.988 | DAIMLER AG - REG | EUR | 842.999,36 | 0,61 |
| 3.296 | DELIVERY HERO SE | EUR | 364.043,20 | 0,26 |
| 3.484 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 489.502,00 | 0,36 |
| 80.010 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 1.391.853,96 | 1,00 |
| 33.051 | EVONIK INDUSTRIES AG | EUR | 901.300,77 | 0,66 |
| 7.068 | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | EUR | 430.158,48 | 0,31 |
| 12.587 | FRESENIUS SE & CO KGAA | EUR | 522.801,05 | 0,38 |
| 5.991 | GEA GROUP AG | EUR | 237.183,69 | 0,17 |
| 256 | HANNOVER RUECK SE | EUR | 38.745,60 | 0,03 |
| 2.871 | HELLOFRESH SE | EUR | 229.565,16 | 0,17 |
| 4.932 | HENKEL AG & CO KGAA | EUR | 367.680,60 | 0,27 |
| 4.583 | HENKEL AG & CO KGAA - REG | EUR | 367.464,94 | 0,27 |
| 1.440 | KNORR-BREMSE AG | EUR | 133.401,60 | 0,10 |
| 4.271 | MERCK KGAA | EUR | 801.453,15 | 0,58 |
| 3.343 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 791.956,70 | 0,58 |
| 1.785 | PUMA AG | EUR | 172.109,70 | 0,13 |
| 19.134 | SAP SE | EUR | 2.236.381,92 | 1,63 |
| 619 | SARTORIUS AG | EUR | 340.326,20 | 0,25 |
| 761 | SCOUT24 AG | EUR | 45.629,56 | 0,03 |
| 15.527 | SIEMENS AG - REG | EUR | 2.203.591,84 | 1,60 |
| 14.028 | SIEMENS ENERGY AG | EUR | 325.870,44 | 0,24 |
| 951 | TEAMVIEWER AG | EUR | 24.145,89 | 0,02 |
| 50.016 | TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | EUR | 122.939,33 | 0,08 |
| 7.727 | VONOVIA SE | EUR | 401.031,30 | 0,29 |
| 3.333 | ZALANDO SE | EUR | 264.373,56 | 0,19 |
| | | | **17.754.373,71** | **12,92** |
| | **Niederlande** | | | |
| 13.638 | ABN AMRO BANK NV - CVA | EUR | 169.847,65 | 0,12 |
| 328 | ADYEN NV | EUR | 792.120,00 | 0,58 |
| 45.418 | AEGON NV | EUR | 202.882,21 | 0,14 |
| 8.680 | AKZO NOBEL NV | EUR | 819.218,40 | 0,60 |
| 1.219 | ARGENX SE | EUR | 316.330,50 | 0,23 |
| 1.133 | ASM INTERNATIONAL NV | EUR | 383.180,60 | 0,28 |
| 6.796 | ASML HOLDING NV | EUR | 4.389.536,40 | 3,20 |
| 22.816 | CNH INDUSTRIAL NV | EUR | 335.395,20 | 0,24 |
| 2.943 | EXOR NV | EUR | 214.603,56 | 0,16 |
| 1.973 | FERRARI NV | EUR | 357.014,35 | 0,26 |
| 30.114 | ING GROEP NV | EUR | 378.472,75 | 0,28 |
| 3.385 | KONINKLIJKE DSM NV | EUR | 584.758,75 | 0,43 |
| 43.830 | KONINKLIJKE KPN NV | EUR | 118.998,45 | 0,09 |
| 20.348 | KONINKLIJKE PHILIPS NV | EUR | 780.142,32 | 0,57 |
| 982 | KONINKLIJKE VOPAK NV | EUR | 33.388,00 | 0,02 |
| 4.987 | NN GROUP NV | EUR | 225.761,49 | 0,16 |
| 12.325 | PROSUS NV | EUR | 850.301,75 | 0,62 |
| 7.886 | QIAGEN NV | EUR | 353.213,94 | 0,26 |
| 2.151 | RANDSTAD NV | EUR | 124.973,10 | 0,09 |
| 42.143 | STELLANTIS NV | EUR | 696.286,65 | 0,51 |
| 16.505 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 623.311,33 | 0,45 |
| 2.624 | WOLTERS KLUWER NV | EUR | 240.305,92 | 0,17 |
| | | | **12.990.043,32** | **9,46** |
| | **Schweden** | | | |
| 10.184 | ALFA LAVAL AB | SEK | 330.054,12 | 0,24 |
| 22.693 | ASSA ABLOY AB - B | SEK | 572.297,50 | 0,42 |
| 9.997 | ATLAS COPCO AB - A | SEK | 524.739,52 | 0,38 |
| 11.416 | ATLAS COPCO AB - B | SEK | 504.981,67 | 0,37 |
| 8.937 | ELECTROLUX AB - B | SEK | 178.314,58 | 0,13 |
| 20.566 | H & M HENNES & MAURITZ AB | SEK | 361.781,63 | 0,26 |
| 14.897 | HUSQVARNA AB - B | SEK | 154.345,54 | 0,11 |
| 2.035 | ICA GRUPPEN AB | SEK | 80.704,49 | 0,06 |
| 7.625 | LUNDIN ENERGY AB | SEK | 245.765,61 | 0,18 |
| 37.978 | SANDVIK AB | SEK | 753.631,91 | 0,55 |
| 12.591 | SECURITAS AB - B | SEK | 172.675,38 | 0,13 |
| 25.182 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB - A | SEK | 307.723,55 | 0,22 |
| 11.438 | SKANSKA AB - B | SEK | 248.972,65 | 0,18 |
| 22.801 | SVENSKA CELLULOSA AB SCA -B | SEK | 306.737,93 | 0,22 |
| 18.817 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB - A | SEK | 182.470,00 | 0,13 |
| 51.557 | TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON - B | SEK | 503.918,73 | 0,37 |
| 11.458 | TELE2 AB - B | SEK | 146.740,50 | 0,11 |
| 58.443 | TELIA CO AB | SEK | 208.228,21 | 0,14 |
| 10.873 | VOLVO AB - A SHS | SEK | 213.189,09 | 0,16 |
| 26.058 | VOLVO AB - B | SEK | 506.452,56 | 0,37 |
| | | | **6.503.725,17** | **4,73** |
| | **Spanien** | | | |
| 1.954 | AENA SME SA | EUR | 291.732,20 | 0,21 |
| 8.795 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 500.259,60 | 0,36 |
| 122.178 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | EUR | 698.491,63 | 0,52 |
| 310.465 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 973.773,47 | 0,72 |
| 38.016 | CAIXABANK SA | EUR | 102.034,94 | 0,07 |
| 25.073 | ENAGAS SA | EUR | 481.526,97 | 0,35 |
| 7.827 | GRIFOLS SA | EUR | 164.993,16 | 0,12 |
| 20.790 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 661.537,80 | 0,48 |
| 31.843 | NATURGY ENERGY GROUP SA | EUR | 692.585,25 | 0,50 |
| 53.918 | REPSOL SA | EUR | 609.165,56 | 0,44 |
| 5.392 | SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA | EUR | 118.731,84 | 0,09 |
| 99.184 | TELEFONICA SA | EUR | 401.397,65 | 0,29 |
| | | | **5.696.230,07** | **4,15** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Dänemark** | | | |
| 2.892 | AMBU AS - B | DKK | 73.836,83 | 0,05 |
| 4.366 | CHR HANSEN HOLDING AS | DKK | 307.900,63 | 0,22 |
| 2.888 | DEMANT AS | DKK | 125.681,07 | 0,09 |
| 4.211 | DSV A/S | DKK | 872.390,87 | 0,64 |
| 1.461 | GENMAB AS | DKK | 551.907,28 | 0,40 |
| 2.669 | GN STORE NORD AS | DKK | 159.760,84 | 0,12 |
| 32.431 | NOVO NORDISK AS - B | DKK | 2.710.165,15 | 1,98 |
| 1.555 | PANDORA AS | DKK | 163.113,22 | 0,12 |
| 20.005 | VESTAS WIND SYSTEMS AS | DKK | 692.755,46 | 0,50 |
| | | | **5.657.511,35** | **4,12** |
| | **Italien** | | | |
| 755 | AMPLIFON SPA | EUR | 31.106,00 | 0,02 |
| 4.876 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA | EUR | 89.669,64 | 0,07 |
| 3 | DIASORIN SPA | EUR | 544,05 | 0,00 |
| 193.195 | ENEL SPA | EUR | 1.284.939,95 | 0,93 |
| 63.251 | ENI SPA | EUR | 730.296,05 | 0,53 |
| 143.245 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 351.451,61 | 0,26 |
| 2.062 | MONCLER SPA | EUR | 109.327,24 | 0,08 |
| 4.359 | NEXI SPA | EUR | 70.441,44 | 0,05 |
| 1.840 | RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA SPA | EUR | 92.515,20 | 0,07 |
| 137.232 | SNAM SPA | EUR | 658.164,67 | 0,48 |
| 150.293 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO RISP | EUR | 52.587,52 | 0,04 |
| 110.422 | TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE | EUR | 677.549,39 | 0,49 |
| 23.535 | UNICREDIT SPA | EUR | 270.652,50 | 0,20 |
| | | | **4.419.245,26** | **3,22** |
| | **Finnland** | | | |
| 6.154 | KESKO OYJ - B | EUR | 183.635,36 | 0,13 |
| 4.245 | NESTE OYJ | EUR | 207.877,65 | 0,15 |
| 100.228 | NOKIA OYJ | EUR | 476.985,05 | 0,35 |
| 58.778 | NORDEA BANK ABP | SEK | 655.656,88 | 0,48 |
| 5.844 | ORION OYJ - B | EUR | 200.157,00 | 0,15 |
| 8.057 | SAMPO OYJ - A | EUR | 345.725,87 | 0,25 |
| 30.175 | STORA ENSO OYJ - R | EUR | 436.481,38 | 0,32 |
| 20.510 | WARTSILA OYJ | EUR | 212.381,05 | 0,15 |
| | | | **2.718.900,24** | **1,98** |
| | **Norwegen** | | | |
| 3.667 | GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | NOK | 70.246,23 | 0,05 |
| 227.900 | NORSK HYDRO ASA | NOK | 1.475.966,72 | 1,08 |
| 35.484 | ORKLA ASA | NOK | 281.367,27 | 0,20 |
| 297 | SCHIBSTED ASA - A | NOK | 12.218,47 | 0,01 |
| 3.093 | SCHIBSTED ASA - B | NOK | 113.670,47 | 0,08 |
| | | | **1.953.469,16** | **1,42** |
| | **Belgien** | | | |
| 4.135 | AGEAS SA/NV | EUR | 177.060,70 | 0,13 |
| 2.608 | KBC GROUP NV | EUR | 203.528,32 | 0,15 |
| 3.019 | PROXIMUS SADP | EUR | 51.745,66 | 0,04 |
| 219 | SOFINA SA | EUR | 75.160,80 | 0,05 |
| 5.575 | UCB SA | EUR | 539.660,00 | 0,39 |
| 14.526 | UMICORE SA | EUR | 744.312,24 | 0,54 |
| | | | **1.791.467,72** | **1,30** |
| | **Irland** | | | |
| 27.096 | CRH PLC | EUR | 1.099.013,76 | 0,80 |
| 1.864 | DCC PLC | GBP | 134.411,18 | 0,10 |
| 12.209 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 554.044,42 | 0,40 |
| | | | **1.787.469,36** | **1,30** |
| | **Jersey** | | | |
| 15.244 | EXPERIAN PLC | GBP | 551.388,34 | 0,40 |
| 4.847 | FERGUSON PLC | GBP | 582.802,51 | 0,42 |
| 35.037 | WPP PLC | GBP | 407.832,59 | 0,30 |
| | | | **1.542.023,44** | **1,12** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 39.457 | AROUNDTOWN SA | EUR | 235.558,29 | 0,17 |
| 2.623 | EUROFINS SCIENTIFIC SE | EUR | 290.733,32 | 0,21 |
| | | | **526.291,61** | **0,38** |
| | **Österreich** | | | |
| 8.533 | OMV AG | EUR | 445.251,94 | 0,32 |
| | | | **445.251,94** | **0,32** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 3.102 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | EUR | 197.349,24 | 0,15 |
| | | | **197.349,24** | **0,15** |
| | **Portugal** | | | |
| 10.821 | JERONIMO MARTINS SGPS SA | EUR | 186.229,41 | 0,14 |
| | | | **186.229,41** | **0,14** |
| | | | **136.922.215,85** | **99,67** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **136.922.215,85** | **99,67** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR |
|---|---|---|---|
| | **Bezugsrechte** | | |
| 23.269 | VEOLIA ENVIRONNEMENT S.A. RIGHTS 01/10/2021 | EUR | 16.707,14 |
| | | | **16.707,14** |
| | **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | **16.707,14** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **136.922.215,85** | **99,67** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **16.707,14** | **0,01** |
| **Bankguthaben** | **455.063,94** | **0,33** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(17.629,41)** | **(0,01)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **137.376.357,52** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 201.580.980,03 |
| | 30.09.2020 | EUR | 143.042.056,03 |
| | 30.09.2019 | EUR | 178.286.335,61 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 90,79 |
| | 30.09.2020 | EUR | 68,96 |
| | 30.09.2019 | EUR | 74,76 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 84,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 64,03 |
| | 30.09.2019 | EUR | 69,60 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 82,53 |
| | 30.09.2020 | EUR | 62,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 67,96 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 79,83 |
| | 30.09.2020 | EUR | 61,19 |
| | 30.09.2019 | EUR | 66,94 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 71,74 |
| | 30.09.2020 | EUR | 55,26 |
| | 30.09.2019 | EUR | 60,77 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 17.053,17 |
| | 30.09.2020 | CZK | 13.111,76 |
| | 30.09.2019 | CZK | 14.484,07 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.145,35 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 50,79 |
| | 30.09.2020 | EUR | 39,40 |
| | 30.09.2019 | EUR | 44,10 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 292,15 |
| | 30.09.2020 | EUR | 226,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 253,44 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 887.348 |
| | 30.09.2020 | | 724.131 |
| | 30.09.2019 | | 919.980 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 5.289 |
| | 30.09.2020 | | 10.345 |
| | 30.09.2019 | | 7.624 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | | 13.949 |
| | 30.09.2020 | | 14.552 |
| | 30.09.2019 | | 14.996 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1.080.407 |
| | 30.09.2020 | 1.240.655 |
| | 30.09.2019 | 1.324.490 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 54.963 |
| | 30.09.2020 | 56.548 |
| | 30.09.2019 | 67.126 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 14.368 |
| | 30.09.2020 | 14.327 |
| | 30.09.2019 | 14.692 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 2.592 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 119.264 |
| | 30.09.2020 | 137.803 |
| | 30.09.2019 | 154.003 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 597 |
| | 30.09.2020 | 597 |
| | 30.09.2019 | 692 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Dividende** | | | |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,50 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 4,40 |

| | | |
|---|---|---|
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,94% |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,10% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,12% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,21% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 138,69% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **200.706.606,29** |
| Aktien | | 200.706.606,29 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **19.711,62** |
| Devisentermingeschäfte | | 19.711,62 |
| **Bankguthaben** | | **207.590,77** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **13.575.633,68** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***214.509.542,36*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(12.928.562,33)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(12.928.562,33)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***201.580.980,03*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **6.033.473,92** |
| Dividenden | | 5.997.983,22 |
| Sonstige Erträge | 10 | 35.490,70 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(2.198.708,36)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.723.444,95) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (405.317,50) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (1.771,00) |
| Abonnementsteuer | 9 | (60.907,20) |
| Bankzinsen | | (7.267,71) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **3.834.765,56** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 24.938.055,68 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (4.388.736,95) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 311.979,98 |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 541.136,23 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (450.572,01) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 21.198.729,11 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 245.927,17 |
| **Ergebnis** | | **46.231.284,77** |
| Zeichnungen | | 74.190.578,91 |
| Rücknahmen | | (61.812.619,94) |
| Ausschüttung | | (70.319,74) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 143.042.056,03 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***201.580.980,03*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 77.488 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 8.075.760,38 | 4,01 |
| 1.191.781 | BARCLAYS PLC | GBP | 2.628.891,76 | 1,30 |
| 65.387 | BHP GROUP PLC | GBP | 1.436.406,36 | 0,71 |
| 48.291 | BURBERRY GROUP PLC | GBP | 1.019.719,54 | 0,51 |
| 134.887 | PERSIMMON PLC | GBP | 4.186.912,02 | 2,08 |
| 170.941 | RELX PLC | EUR | 4.273.525,00 | 2,12 |
| 27.196 | RIO TINTO PLC | GBP | 1.554.654,57 | 0,77 |
| 301.742 | ROYAL DUTCH SHELL PLC - A | EUR | 5.863.450,54 | 2,91 |
| 234.757 | TATE & LYLE PLC | GBP | 1.889.457,05 | 0,94 |
| 1.282.472 | TESCO PLC | GBP | 3.779.383,80 | 1,86 |
| 58.566 | UNILEVER PLC | EUR | 2.731.811,07 | 1,36 |
| 126.361 | 3I GROUP PLC | GBP | 1.883.950,90 | 0,93 |
| | | | **39.323.922,99** | **19,50** |
| **Deutschland** | | | | |
| 44.213 | COVESTRO AG | EUR | 2.623.599,42 | 1,30 |
| 68.001 | DAIMLER AG - REG | EUR | 5.217.036,72 | 2,59 |
| 109.712 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 5.977.109,76 | 2,97 |
| 316.142 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 5.499.606,23 | 2,73 |
| 338.599 | E.ON SE | EUR | 3.578.314,23 | 1,77 |
| 8.559 | LEG IMMOBILIEN SE | EUR | 1.045.909,80 | 0,52 |
| 65.684 | PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | EUR | 1.041.748,24 | 0,52 |
| 22.302 | SAP SE | EUR | 2.606.657,76 | 1,29 |
| 46.554 | SIEMENS AG - REG | EUR | 6.606.943,68 | 3,28 |
| 17.688 | SIEMENS HEALTHINEERS AG | EUR | 993.711,84 | 0,49 |
| | | | **35.190.637,68** | **17,46** |
| **Frankreich** | | | | |
| 37.365 | AMUNDI SA | EUR | 2.723.908,50 | 1,35 |
| 54.666 | BNP PARIBAS SA | EUR | 3.030.683,04 | 1,50 |
| 57.088 | BOUYGUES SA | EUR | 2.049.459,20 | 1,02 |
| 100.606 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 5.859.293,44 | 2,91 |
| 125.120 | ENGIE SA | EUR | 1.419.111,04 | 0,70 |
| 12.710 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 7.881.471,00 | 3,91 |
| 127.929 | REXEL SA | EUR | 2.144.729,69 | 1,07 |
| 71.304 | SANOFI | EUR | 5.923.936,32 | 2,94 |
| 93.132 | VIVENDI SE | EUR | 1.015.604,46 | 0,50 |
| | | | **32.048.196,69** | **15,90** |
| **Schweiz** | | | | |
| 13.036 | LOGITECH INTERNATIONAL SA - REG | CHF | 1.003.931,85 | 0,50 |
| 76.707 | NESTLE SA - REG | CHF | 7.996.176,82 | 3,97 |
| 4.752 | ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN | CHF | 1.503.012,23 | 0,75 |
| 13.348 | SONOVA HOLDING AG - REG | CHF | 4.385.434,52 | 2,18 |
| 2.700 | SWISS LIFE HOLDING AG - REG | CHF | 1.182.516,54 | 0,59 |
| 373.635 | UBS GROUP AG - REG | CHF | 5.183.967,69 | 2,56 |
| 14.324 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 5.082.371,26 | 2,52 |
| | | | **26.337.410,91** | **13,07** |
| **Niederlande** | | | | |
| 284.142 | AEGON NV | EUR | 1.269.262,31 | 0,63 |
| 18.260 | ASML HOLDING NV | EUR | 11.794.134,00 | 5,85 |
| 27.408 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 1.083.164,16 | 0,54 |
| 20.018 | HEINEKEN NV | EUR | 1.805.623,60 | 0,90 |
| 187.134 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 5.377.295,49 | 2,67 |
| 184.123 | STELLANTIS NV | EUR | 3.052.022,85 | 1,51 |
| | | | **24.381.502,41** | **12,10** |
| **Dänemark** | | | | |
| 1.042 | AP MOLLER - MAERSK AS - B | DKK | 2.436.164,34 | 1,21 |
| 79.330 | NOVO NORDISK AS - B | DKK | 6.629.379,34 | 3,29 |
| | | | **9.065.543,68** | **4,50** |
| **Finnland** | | | | |
| 579.402 | NORDEA BANK ABP | SEK | 6.463.113,84 | 3,21 |
| | | | **6.463.113,84** | **3,21** |
| **Norwegen** | | | | |
| 252.993 | EQUINOR ASA | NOK | 5.567.876,00 | 2,76 |
| | | | **5.567.876,00** | **2,76** |
| **Schweden** | | | | |
| 128.406 | BOLIDEN AB | SEK | 3.575.159,37 | 1,77 |
| 61.708 | LUNDIN ENERGY AB | SEK | 1.988.944,80 | 0,99 |
| | | | **5.564.104,17** | **2,76** |
| **Italien** | | | | |
| 2.169.205 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 5.322.144,47 | 2,64 |
| | | | **5.322.144,47** | **2,64** |
| **Luxemburg** | | | | |
| 28.914 | APERAM SA | EUR | 1.384.402,32 | 0,69 |
| 115.104 | ARCELORMITTAL SA | EUR | 3.045.651,84 | 1,51 |
| | | | **4.430.054,16** | **2,20** |
| **Spanien** | | | | |
| 318.437 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 998.777,65 | 0,49 |
| 119.924 | IBERDROLA SA | EUR | 1.041.420,02 | 0,52 |
| 31.612 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 1.005.893,84 | 0,50 |
| | | | **3.046.091,51** | **1,51** |
| **Österreich** | | | | |
| 68.535 | WIENERBERGER AG | EUR | 1.997.109,90 | 0,98 |
| | | | **1.997.109,90** | **0,98** |
| **Irland** | | | | |
| 26.052 | CRH PLC | EUR | 1.056.669,12 | 0,53 |
| 20.102 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 912.228,76 | 0,45 |
| | | | **1.968.897,88** | **0,98** |
| | | | **200.706.606,29** | **99,57** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **200.706.606,29** | **99,57** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 247.816.546,03 | CZK | 9.750.612,58 | EUR | 19/10/2021 | 9.750.612,58 | 19.756,35 |
| 21.595,84 | EUR | 548.893,37 | CZK | 19/10/2021 | 21.595,84 | (44,73) |
| | | | | | **9.772.208,42** | **19.711,62** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **19.711,62** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **200.706.606,29** | **99,57** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **19.711,62** | **0,01** |
| **Bankguthaben** | **207.590,77** | **0,10** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **647.071,35** | **0,32** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **201.580.980,03** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 209.640.445,70 |
| | 30.09.2020 | EUR | 194.649.872,62 |
| | 30.09.2019 | EUR | 288.337.061,13 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 559,14 |
| | 30.09.2020 | EUR | 439,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | 482,87 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 50.325,68 |
| | 30.09.2020 | PLN | 39.396,91 |
| | 30.09.2019 | PLN | 42.999,24 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 509,64 |
| | 30.09.2020 | EUR | 400,89 |
| | 30.09.2019 | EUR | 440,92 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 474,51 |
| | 30.09.2020 | EUR | 376,62 |
| | 30.09.2019 | EUR | 417,98 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (USD) | 30.09.2021 | USD | 369,95 |
| | 30.09.2020 | USD | 294,41 |
| | 30.09.2019 | USD | 319,20 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 292,95 |
| | 30.09.2020 | EUR | 230,77 |
| | 30.09.2019 | EUR | 254,20 |
| Capitalisation S (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 435,85 |
| | 30.09.2019 | EUR | 480,42 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 175,46 |
| | 30.09.2020 | EUR | 139,14 |
| | 30.09.2019 | EUR | 154,28 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 436,40 |
| | 30.09.2020 | EUR | 348,11 |
| | 30.09.2019 | EUR | 388,27 |
| Capitalisation X Hedged (ii) (USD) | 30.09.2021 | USD | 349,00 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | 302,15 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 296,48 |
| | 30.09.2020 | EUR | 240,20 |
| | 30.09.2019 | EUR | 272,90 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 275,82 |
| | 30.09.2020 | EUR | 225,49 |
| | 30.09.2019 | EUR | 258,55 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 269,93 |
| | 30.09.2020 | EUR | 219,02 |
| | 30.09.2019 | EUR | 249,21 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 166.068 |
| | 30.09.2020 | 215.817 |
| | 30.09.2019 | 331.170 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 2.262 |
| | 30.09.2020 | 2.238 |
| | 30.09.2019 | 2.725 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 93.528 |
| | 30.09.2020 | 101.022 |
| | 30.09.2019 | 105.639 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 53.681 |
| | 30.09.2020 | 57.524 |
| | 30.09.2019 | 65.738 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (USD) | 30.09.2021 | 12.300 |
| | 30.09.2020 | 12.487 |
| | 30.09.2019 | 12.487 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 4.650 |
| | 30.09.2020 | 8.064 |
| | 30.09.2019 | 9.722 |
| Capitalisation S (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 0.24 |
| | 30.09.2019 | 97 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 7.901 |
| | 30.09.2020 | 15.953 |
| | 30.09.2019 | 45.744 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 14.956 |
| | 30.09.2020 | 16.362 |
| | 30.09.2019 | 19.207 |
| Capitalisation X Hedged (ii) (USD) | 30.09.2021 | 84 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 185 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 3.592 |
| | 30.09.2020 | 3.155 |
| | 30.09.2019 | 2.597 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 13.796 |
| | 30.09.2020 | 17.571 |
| | 30.09.2019 | 21.030 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 3.019 |
| | 30.09.2020 | 2.608 |
| | 30.09.2019 | 2.702 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution N (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 7,50 |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 7,05 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 6,85 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P Hedged (ii) (USD) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 1,71% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X Hedged (ii) (USD) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 156,10% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **208.778.965,17** |
| Aktien | | 208.778.965,17 |
| **Bankguthaben** | | **1.000.785,87** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **5.433.466,97** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***215.213.218,01*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(5.121.375,53)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(451.396,78)** |
| Devisentermingeschäfte | | (451.396,78) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(5.572.772,31)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***209.640.445,70*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **7.731.198,24** |
| Dividenden | | 7.421.562,67 |
| Sonstige Erträge | 10 | 309.635,57 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(2.260.609,88)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.693.338,30) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (477.027,20) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (5.402,13) |
| Abonnementsteuer | 9 | (58.456,13) |
| Bankzinsen | | (26.386,12) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **5.470.588,36** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 30.893.145,76 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (8.620.131,77) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 136,58 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (310.522,32) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 721.133,62 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (672.368,71) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 22.852.113,24 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 96.008,05 |
| **Ergebnis** | | **50.430.102,81** |
| Zeichnungen | | 45.214.730,79 |
| Rücknahmen | | (80.502.005,83) |
| Ausschüttung | | (152.254,69) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 194.649.872,62 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***209.640.445,70*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Deutschland** | | | | |
| 65.927 | COVESTRO AG | EUR | 3.912.108,18 | 1,87 |
| 34.119 | DAIMLER AG - REG | EUR | 2.617.609,68 | 1,25 |
| 8.212 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 1.153.786,00 | 0,55 |
| 57.961 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 3.157.715,28 | 1,51 |
| 219.677 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 3.821.501,09 | 1,82 |
| 384.013 | E.ON SE | EUR | 4.058.249,38 | 1,93 |
| 38.691 | EVONIK INDUSTRIES AG | EUR | 1.055.103,57 | 0,50 |
| 144.499 | INFINEON TECHNOLOGIES AG | EUR | 5.133.326,98 | 2,45 |
| 18.108 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 4.289.785,20 | 2,05 |
| 27.615 | SAP SE | EUR | 3.227.641,20 | 1,54 |
| 60.228 | SIEMENS AG - REG | EUR | 8.547.557,76 | 4,08 |
| 35.601 | SIEMENS HEALTHINEERS AG | EUR | 2.000.064,18 | 0,95 |
| 14.678 | STROEER SE & CO KGAA | EUR | 1.046.541,40 | 0,50 |
| | | | **44.020.989,90** | **21,00** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 90.488 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 9.430.613,84 | 4,50 |
| 1.173.068 | HSBC HOLDINGS PLC | GBP | 5.323.305,42 | 2,54 |
| 92.076 | MONDI PLC | GBP | 1.959.822,65 | 0,93 |
| 1.391.009 | NATWEST GROUP PLC | GBP | 3.639.630,62 | 1,74 |
| 63.061 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | GBP | 4.277.276,47 | 2,04 |
| 78.354 | RELX PLC | GBP | 1.957.181,63 | 0,93 |
| 589.398 | ROYAL DUTCH SHELL PLC - A | GBP | 11.348.659,62 | 5,41 |
| 103.356 | UNILEVER PLC | GBP | 4.815.885,22 | 2,30 |
| | | | **42.752.375,47** | **20,39** |
| **Schweiz** | | | | |
| 110.990 | NESTLE SA - REG | CHF | 11.569.943,62 | 5,52 |
| 74.760 | NOVARTIS AG - REG | CHF | 5.312.801,64 | 2,53 |
| 31.572 | ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN | CHF | 9.985.922,18 | 4,76 |
| 30.033 | STADLER RAIL AG | CHF | 1.082.839,34 | 0,52 |
| 264.340 | UBS GROUP AG - REG | CHF | 3.667.563,31 | 1,75 |
| 17.794 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 6.313.579,60 | 3,01 |
| | | | **37.932.649,69** | **18,09** |
| **Frankreich** | | | | |
| 47.507 | BNP PARIBAS SA | EUR | 2.633.788,08 | 1,26 |
| 31.072 | BOUYGUES SA | EUR | 1.115.484,80 | 0,53 |
| 10.301 | CAPGEMINI SE | EUR | 1.855.725,15 | 0,89 |
| 23.589 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA | EUR | 3.132.619,20 | 1,49 |
| 105.160 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 6.124.518,40 | 2,92 |
| 313.402 | ENGIE SA | EUR | 3.554.605,48 | 1,70 |
| 6.581 | KERING SA | EUR | 4.053.896,00 | 1,93 |
| 10.733 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 6.655.533,30 | 3,17 |
| 11.902 | PERNOD RICARD SA | EUR | 2.269.711,40 | 1,08 |
| 131.000 | REXEL SA | EUR | 2.196.215,00 | 1,05 |
| 36.230 | VINCI SA | EUR | 3.266.134,50 | 1,56 |
| | | | **36.858.231,31** | **17,58** |
| **Niederlande** | | | | |
| 42.649 | AIRBUS SE | EUR | 4.908.899,90 | 2,34 |
| 65.503 | HEINEKEN NV | EUR | 5.908.370,60 | 2,82 |
| 170.919 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 4.911.357,47 | 2,34 |
| 310.671 | STELLANTIS NV | EUR | 5.149.682,50 | 2,46 |
| | | | **20.878.310,47** | **9,96** |
| **Italien** | | | | |
| 2.129.555 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 5.224.863,19 | 2,49 |
| 316.854 | UNICREDIT SPA | EUR | 3.643.821,00 | 1,74 |
| | | | **8.868.684,19** | **4,23** |
| **Finnland** | | | | |
| 444.262 | NORDEA BANK ABP | SEK | 4.955.654,07 | 2,36 |
| 49.625 | UPM-KYMMENE OYJ | EUR | 1.523.983,75 | 0,73 |
| | | | **6.479.637,82** | **3,09** |
| **Schweden** | | | | |
| 300.794 | TELE2 AB - B | SEK | 3.852.213,37 | 1,84 |
| | | | **3.852.213,37** | **1,84** |
| **Norwegen** | | | | |
| 127.482 | EQUINOR ASA | NOK | 2.805.626,91 | 1,34 |
| | | | **2.805.626,91** | **1,34** |
| **Belgien** | | | | |
| 23.137 | UCB SA | EUR | 2.239.661,60 | 1,07 |
| | | | **2.239.661,60** | **1,07** |
| **Luxemburg** | | | | |
| 43.663 | APERAM SA | EUR | 2.090.584,44 | 1,00 |
| | | | **2.090.584,44** | **1,00** |
| | | | **208.778.965,17** | **99,59** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **208.778.965,17** | **99,59** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 2.829.952,53 | USD | 2.388.879,59 | EUR | 19/10/2021 | 2.388.879,59 | 52.224,57 |
| 1.016.113,12 | USD | 737.059,86 | GBP | 19/10/2021 | 861.109,08 | 19.218,93 |
| 841.386,98 | USD | 769.571,66 | CHF | 19/10/2021 | 712.750,49 | 13.887,84 |
| 194.990,87 | USD | 1.677.087,85 | SEK | 19/10/2021 | 165.168,19 | 2.821,18 |
| 68.675,66 | USD | 595.217,29 | NOK | 19/10/2021 | 57.871,01 | 428,69 |
| 2,17 | USD | 13,63 | DKK | 19/10/2021 | 1,84 | 0,04 |
| 88.480,55 | NOK | 10.215,68 | USD | 19/10/2021 | 8.653,79 | (69,65) |
| 152.529,94 | EUR | 703.219,31 | PLN | 19/10/2021 | 152.529,94 | (212,90) |
| 72.026,28 | GBP | 99.657,65 | USD | 19/10/2021 | 84.096,34 | (2.190,33) |
| 232.063,79 | EUR | 271.712,87 | USD | 19/10/2021 | 232.063,79 | (2.314,50) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | Zu zahlen | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| 117.482.772,11 PLN | 26.053.050,47 EUR | 19/10/2021 | 26.053.050,47 | (535.190,65) |
| | | | **30.716.174,53** | **(451.396,78)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(451.396,78)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **208.778.965,17** | **99,59** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(451.396,78)** | **(0,22)** |
| **Bankguthaben** | **1.000.785,87** | **0,48** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **312.091,44** | **0,15** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **209.640.445,70** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 139.908.509,31 |
| | 30.09.2020 | EUR | 106.174.848,60 |
| | 30.09.2019 | EUR | 166.487.735,66 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.309,91 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.731,19 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.627,19 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 7.788,04 |
| | 30.09.2020 | USD | 7.011,63 |
| | 30.09.2019 | USD | 6.738,98 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 6.259,60 |
| | 30.09.2020 | CHF | 5.730,99 |
| | 30.09.2019 | CHF | 5.624,72 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 9.995,18 |
| | 30.09.2020 | EUR | 9.137,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | 8.960,53 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 477,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 433,00 |
| | 30.09.2019 | EUR | 424,78 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 458,82 |
| | 30.09.2020 | EUR | 418,48 |
| | 30.09.2019 | EUR | 412,63 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 301,86 |
| | 30.09.2020 | CHF | 277,52 |
| | 30.09.2019 | CHF | 273,55 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (USD) | 30.09.2021 | USD | 363,09 |
| | 30.09.2020 | USD | 330,30 |
| | 30.09.2019 | USD | 318,83 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 262,55 |
| | 30.09.2019 | EUR | 257,84 |
| Capitalisation S (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.527,30 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.931,00 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.825,85 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 440,27 |
| | 30.09.2020 | EUR | 403,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 399,96 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 9.460,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | 8.531,49 |
| | 30.09.2019 | EUR | 8.317,05 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 296.222,85 |
| | 30.09.2020 | EUR | 266.726,37 |
| | 30.09.2019 | EUR | 259.632,01 |
| Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.300,80 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.000,87 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.043,73 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.372,66 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.280,99 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.285,21 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.376,23 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.284,18 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.288,34 |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 260,78 |
| | 30.09.2020 | EUR | 243,43 |
| | 30.09.2019 | EUR | 244,22 |
| Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY) | 30.09.2021 | JPY | 10.739,00 |
| | 30.09.2020 | JPY | - |
| | 30.09.2019 | JPY | - |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 553 |
| | 30.09.2020 | | 255 |
| | 30.09.2019 | | 2.790 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | | 186 |
| | 30.09.2020 | | 239 |
| | 30.09.2019 | | 646 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (CHF) | 30.09.2021 | | 36 |
| | 30.09.2020 | | 36 |
| | 30.09.2019 | | 44 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | | 3.450 |
| | 30.09.2020 | | 3.232 |
| | 30.09.2019 | | 3.735 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 3.449 |
| | 30.09.2020 | | 2.387 |
| | 30.09.2019 | | 13.297 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 12.733 |
| | 30.09.2020 | | 17.422 |
| | 30.09.2019 | | 20.733 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (CHF) | 30.09.2021 | | 616 |
| | 30.09.2020 | | 616 |
| | 30.09.2019 | | 616 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (USD) | 30.09.2021 | | 4.129 |
| | 30.09.2020 | | 5.845 |
| | 30.09.2019 | | 8.783 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | - |
| | 30.09.2020 | | 224 |
| | 30.09.2019 | | 308 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation S (EUR) | 30.09.2021 | 8 |
| | 30.09.2020 | 8 |
| | 30.09.2019 | 8 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 4.008 |
| | 30.09.2020 | 1.431 |
| | 30.09.2019 | 1.857 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 6.203 |
| | 30.09.2020 | 4.700 |
| | 30.09.2019 | 6.342 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 7 |
| | 30.09.2020 | 8 |
| | 30.09.2019 | 12 |
| Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1.223 |
| | 30.09.2020 | 943 |
| | 30.09.2019 | 4.383 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 11.104 |
| | 30.09.2020 | 11.040 |
| | 30.09.2019 | 11.546 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 831 |
| | 30.09.2020 | 1.040 |
| | 30.09.2019 | 1.473 |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | 2.511 |
| | 30.09.2020 | 1.348 |
| | 30.09.2019 | 2.459 |
| Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY) | 30.09.2021 | 65.429 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR) | 11.08.2021 | EUR | 42,00 |
| Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR) | 12.05.2021 | EUR | 44,40 |
| Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR) | 11.02.2021 | EUR | 42,45 |
| Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR) | 11.11.2020 | EUR | 37,00 |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 30,55 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 35,80 |
| Distribution X (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 4,60 |
| Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY) | 02.09.2021 | JPY | 23,19 |
| Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY) | 03.08.2021 | JPY | 23,19 |
| Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY) | 02.07.2021 | JPY | 23,19 |
| Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY) | 02.06.2021 | JPY | 31,00 |
| Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY) | 04.05.2021 | JPY | 31,00 |
| Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY) | 07.04.2021 | JPY | 31,00 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation I Hedged (ii) (CHF) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,80% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,30% |
| Capitalisation P Hedged (ii) (CHF) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Capitalisation P Hedged (ii) (USD) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Capitalisation S (EUR) | 30.09.2021 | 0,92% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,16% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 0,01% |
| Distribution I (Q) Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,30% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution Z (M) Hedged (ii) (JPY) | 30.09.2021 | 0,18% |

**Portfolioumsatz in %*** 30.09.2021 39,73%

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **135.349.849,32** |
| Aktien | | 1.295.417,45 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 2.417.472,46 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 131.636.959,41 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **17.502,23** |
| Devisentermingeschäfte | | 17.502,23 |
| **Bankguthaben** | | **3.930.336,39** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **11.465.987,59** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***150.763.675,53*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(10.855.166,22)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(10.855.166,22)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***139.908.509,31*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **6.239.399,00** |
| Dividenden | | 2.462,50 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 5.992.735,62 |
| Sonstige Erträge | 10 | 244.200,88 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(909.765,04)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (626.042,52) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (231.190,17) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (10.369,80) |
| Abonnementsteuer | 9 | (24.519,00) |
| Bankzinsen | | (17.643,55) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **5.329.633,96** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 4.004.992,03 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (37.632.443,91) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 1.990.832,05 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (5.773.481,16) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 267.066,78 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (343.722,82) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 39.994.422,64 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 3.834.563,00 |
| **Ergebnis** | | **11.671.862,57** |
| Zeichnungen | | 79.219.773,07 |
| Rücknahmen | | (56.527.386,96) |
| Ausschüttung | | (630.587,97) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 106.174.848,60 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***139.908.509,31*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| | **Frankreich** | | | |
| 64.664 | VALLOUREC SA | EUR | 488.213,20 | 0,35 |
| | | | **488.213,20** | **0,35** |
| | **Kroatien** | | | |
| 245.984 | FORTENOVA EQUITY | EUR | 418.172,80 | 0,30 |
| | | | **418.172,80** | **0,30** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 20.494 | HEXION HOLDINGS CORP | USD | 389.031,45 | 0,28 |
| | | | **389.031,45** | **0,28** |
| | | | **1.295.417,45** | **0,93** |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Frankreich** | | | |
| 300.000 | ACCOR SA FRN PERP | EUR | 289.183,16 | 0,21 |
| 400.000 | ACCOR SA FRN PERP | EUR | 413.238,81 | 0,30 |
| 1.200.000 | ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025 | EUR | 1.164.058,80 | 0,83 |
| 500.000 | ALTICE FRANCE SA 3.375% 15/01/2028 | EUR | 481.250,00 | 0,34 |
| 245.000 | ALTICE FRANCE SA 4.125% 15/01/2029 | EUR | 242.556,32 | 0,17 |
| 293.000 | ALTICE FRANCE SA/FRANCE 4.000% 15/07/2029 | EUR | 288.308,42 | 0,21 |
| 850.000 | CASINO GUICHARD PERRACHO 5.250% 15/04/2027 | EUR | 855.369,60 | 0,61 |
| 400.000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA FRN PERP EMTN | EUR | 286.071,70 | 0,20 |
| 3.500.000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1.865% 13/06/2022 EMTN | EUR | 3.488.330,65 | 2,50 |
| 400.000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA 2.798% 05/08/2026 EMTN | EUR | 390.118,66 | 0,28 |
| 400.000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA 4.498% 07/03/2024 EMTN | EUR | 402.619,54 | 0,29 |
| 600.000 | CMA CGM SA 5.250% 15/01/2025 | EUR | 608.514,02 | 0,43 |
| 930.000 | CONSTELLIUM SE 3.125% 15/07/2029 | EUR | 934.638,88 | 0,67 |
| 900.000 | CONSTELLIUM SE 4.250% 15/02/2026 | EUR | 911.250,00 | 0,65 |
| 1.500.000 | CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA 2.625% 30/09/2024 | EUR | 1.569.375,00 | 1,12 |
| 1.200.000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA FRN PERP | EUR | 1.218.969,94 | 0,87 |
| 775.000 | FAURECIA SE 2.375% 15/06/2027 | EUR | 779.018,75 | 0,56 |
| 800.000 | FAURECIA SE 2.375% 15/06/2029 | EUR | 808.386,48 | 0,58 |
| 500.000 | FAURECIA SE 3.125% 15/06/2026 | EUR | 511.855,19 | 0,37 |
| 230.000 | FAURECIA SE 3.750% 15/06/2028 | EUR | 239.366,87 | 0,17 |
| 600.000 | KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026 | EUR | 603.000,00 | 0,43 |
| 600.000 | LA FINANCIERE ATALIAN SASU 4.000% 15/05/2024 | EUR | 589.589,49 | 0,42 |
| 1.000.000 | LOXAM SAS 3.250% 14/01/2025 | EUR | 1.007.836,79 | 0,72 |
| 1.000.000 | PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028 | EUR | 1.012.500,00 | 0,72 |
| 1.500.000 | PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026 | EUR | 1.524.025,05 | 1,09 |
| 805.000 | QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024 | EUR | 829.150,00 | 0,59 |
| 1.000.000 | RUBIS TERMINAL INFRA SAS 5.625% 15/05/2025 | EUR | 1.050.307,40 | 0,75 |
| 1.000.000 | VALLOUREC SA 8.500% 30/06/2026 | EUR | 1.025.307,84 | 0,73 |
| | | | **23.524.197,36** | **16,81** |
| | **Niederlande** | | | |
| 700.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP | EUR | 691.250,00 | 0,49 |
| 700.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP | EUR | 719.077,38 | 0,51 |
| 1.200.000 | AXALTA COATING SYSTEMS DUTCH HOLDING B BV 3.750% 15/01/2025 | EUR | 1.220.034,67 | 0,87 |
| 1.100.000 | DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV 9.000% 15/07/2025 | EUR | 1.194.000,70 | 0,85 |
| 1.100.000 | FUGRO NV 4.000% 26/10/2021 | EUR | 1.099.676,03 | 0,79 |
| 1.212.000 | NOBEL BIDCO BV 3.125% 15/06/2028 | EUR | 1.204.425,00 | 0,86 |
| 1.500.000 | NOBIAN FINANCE BV 3.625% 15/07/2026 | EUR | 1.487.549,99 | 1,06 |
| 633.000 | REPSOL INTERNATIONAL FINANCE BV FRN PERP | EUR | 693.487,95 | 0,50 |
| 2.000.000 | SIGMA HOLDCO BV 5.750% 15/05/2026 | EUR | 1.908.196,56 | 1,37 |
| 493 | STICHTING AK RABOBANK CERTIFICATEN 19.436% PERP STEP-UP | EUR | 708,74 | 0,00 |
| 800.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 826.499,42 | 0,59 |
| 1.900.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 2.061.108,64 | 1,48 |
| 1.250.000 | TEVA PHARMACEUTICAL FINANCE NETHERLANDS II BV 1.125% 15/10/2024 | EUR | 1.193.750,00 | 0,85 |
| 835.000 | TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 3.750% 15/08/2026 | EUR | 854.630,07 | 0,61 |
| 1.000.000 | VZ VENDOR FINANCING II BV 2.875% 15/01/2029 | EUR | 988.918,02 | 0,71 |
| 600.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2.500% 23/10/2027 | EUR | 613.236,26 | 0,44 |
| 1.000.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 3.000% 23/10/2029 | EUR | 1.040.125,05 | 0,74 |
| 1.300.000 | ZIGGO BV 2.875% 15/01/2030 | EUR | 1.312.677,89 | 0,94 |
| | | | **19.109.352,37** | **13,66** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.600.000 | BELLIS ACQUISITION CO PLC 3.250% 16/02/2026 | GBP | 1.828.902,09 | 1,31 |
| 206.000 | BELLIS FINCO PLC 4.000% 16/02/2027 | GBP | 234.333,21 | 0,17 |
| 200.000 | CARNIVAL PLC 1.000% 28/10/2029 | EUR | 155.500,00 | 0,11 |
| 2.400.000 | EC FINANCE PLC 2.375% 15/11/2022 | EUR | 2.407.837,85 | 1,72 |
| 1.091.000 | EC FINANCE PLC 3.000% 15/10/2026 | EUR | 1.099.182,50 | 0,79 |
| 650.000 | EG GLOBAL FINANCE PLC 6.250% 30/10/2025 | EUR | 664.625,00 | 0,48 |
| 400.000 | EG GLOBAL FINANCE PLC 6.750% 07/02/2025 | USD | 354.296,77 | 0,25 |
| 700.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC 3.750% 15/07/2026 | EUR | 719.484,06 | 0,51 |
| 1.500.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 2.500% 15/01/2026 | EUR | 1.513.178,60 | 1,08 |
| 300.000 | JAGUAR LAND ROVER AUTOMOIVE 4.500% 15/01/2026 | EUR | 303.796,47 | 0,22 |
| 650.000 | JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 2.200% 15/01/2024 | EUR | 635.375,00 | 0,45 |
| 300.000 | JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 5.875% 15/11/2024 | EUR | 319.902,81 | 0,23 |
| 1.200.000 | MATALAN FINANCE PLC 6.750% 31/01/2023 | GBP | 1.314.291,16 | 0,94 |
| 1.200.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 6.500% 15/02/2023 | EUR | 1.220.945,56 | 0,87 |
| 591.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 8.000% 15/02/2023 | USD | 520.396,15 | 0,37 |
| 1.000.000 | STONEGATE PUB CO FINANCING 2019 PLC 8.250% 31/07/2025 | GBP | 1.223.537,29 | 0,87 |
| 1.500.000 | VMED O2 UK FINANCING I PLC 3.250% 31/01/2031 | EUR | 1.539.948,62 | 1,10 |
| 750.000 | WILLIAM HILL LTD 4.750% 01/05/2026 | GBP | 946.197,12 | 0,68 |
| | | | **17.001.730,26** | **12,15** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 800.000 | ADLER GROUP SA 1.875% 14/01/2026 | EUR | 676.000,00 | 0,48 |
| 400.000 | ADLER GROUP SA 2.250% 14/01/2029 | EUR | 326.000,00 | 0,23 |
| 1.000.000 | ADLER GROUP SA 2.250% 27/04/2027 | EUR | 835.000,00 | 0,60 |
| 1.400.000 | ALTICE FINANCING SA 2.250% 15/01/2025 | EUR | 1.347.500,00 | 0,96 |
| 2.000.000 | ALTICE FRANCE HOLDING SA 8.000% 15/05/2027 | EUR | 2.130.397,64 | 1,52 |
| 1.100.000 | ARD FINANCE SA 5.000% 30/06/2027 | EUR | 1.142.734,30 | 0,82 |
| 5.500.000 | GALAPAGOS HOLDING SA 7.000% 15/06/2022 - DEFAULTED | EUR | 165.000,00 | 0,12 |
| 1.200.000 | KLEOPATRA FINCO SARL 4.250% 01/03/2026 | EUR | 1.176.050,54 | 0,84 |
| 450.000 | KLEOPATRA HOLDINGS 2 SCA 6.500% 01/09/2026 | EUR | 424.852,43 | 0,30 |
| 1.300.000 | LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01/04/2024 | EUR | 1.310.643,31 | 0,94 |
| 600.000 | MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA 15/12/2050 FRN EMTN | EUR | 304.627,02 | 0,22 |
| 1.000.000 | MOTION FINCO SARL 7.000% 15/05/2025 | EUR | 1.051.716,41 | 0,75 |
| 315.368 | SUMMER BC HOLDCO A SARL 9.250% 31/10/2027 | EUR | 342.963,16 | 0,25 |
| 1.400.000 | SUMMER BC HOLDCO B SARL 5.750% 31/10/2026 | EUR | 1.466.500,00 | 1,05 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 600.000 | VIVION INVESTMENTS SARL 3.000% 08/08/2024 | EUR | 585.000,00 | 0,42 |
| 400.000 | VIVION INVESTMENTS SARL 3.500% 01/11/2025 | EUR | 396.168,50 | 0,28 |
| | | | **13.681.153,31** | **9,78** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 265.000 | AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC 12.000% 15/06/2026 | USD | 221.164,21 | 0,16 |
| 650.000 | BOXER PARENT CO INC 6.500% 02/10/2025 | EUR | 682.663,92 | 0,49 |
| 1.000.000 | CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026 | EUR | 1.020.000,00 | 0,73 |
| 613.000 | CHEMOURS CO/THE 4.625% 15/11/2029 | USD | 516.584,81 | 0,37 |
| 929.000 | COTY INC 3.875% 15/04/2026 | EUR | 951.142,76 | 0,68 |
| 2.000.000 | COTY INC 4.000% 15/04/2023 | EUR | 2.016.516,02 | 1,44 |
| 1.000.000 | FORD MOTOR CO 8.500% 21/04/2023 | USD | 948.450,18 | 0,68 |
| 250.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.386% 17/02/2026 | EUR | 257.678,51 | 0,18 |
| 500.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.748% 14/06/2024 EMTN | GBP | 588.348,33 | 0,42 |
| 500.000 | HEXION INC 7.875% 15/07/2027 | USD | 461.449,16 | 0,33 |
| 1.000.000 | KRATON POLYMERS LLC / KRATON POLYMERS CAPITAL CORP 5.250% 15/05/2026 | EUR | 1.029.173,73 | 0,74 |
| 3.000.000 | NOKIA OF AMERICA CORP 6.450% 15/03/2029 | USD | 2.922.768,75 | 2,09 |
| 228.000 | OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 3.875% 01/10/2028 | EUR | 228.344,46 | 0,16 |
| 1.300.000 | RAIN CII CARBON LLC / CII CARBON CORP 7.250% 01/04/2025 | USD | 1.151.191,31 | 0,82 |
| | | | **12.995.476,15** | **9,29** |
| | **Deutschland** | | | |
| 1.250.000 | ADLER PELZER HOLDING GMBH 4.125% 01/04/2024 | EUR | 1.186.078,54 | 0,85 |
| 550.000 | APCOA PARKING HOLDINGS GMBH 4.625% 15/01/2027 | EUR | 556.429,37 | 0,40 |
| 500.000 | CONSUS REAL ESTATE AG 4.000% 29/11/2022 | EUR | 487.797,70 | 0,35 |
| 800.000 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 12/08/2075 FRN | EUR | 785.405,74 | 0,56 |
| 800.000 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.000% 29/05/2026 EMTN | EUR | 824.000,00 | 0,59 |
| 700.000 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.750% 11/02/2028 EMTN | EUR | 735.636,19 | 0,53 |
| 900.000 | HT TROPLAST GMBH 9.250% 15/07/2025 | EUR | 987.703,06 | 0,71 |
| 1.500.000 | IHO VERWALTUNGS GMBH 3.625% 15/05/2025 | EUR | 1.525.976,87 | 1,08 |
| 1.000.000 | SCHAEFFLER AG 3.375% 12/10/2028 EMTN | EUR | 1.120.000,00 | 0,80 |
| 400.000 | SGL CARBON SE 4.625% 30/09/2024 | EUR | 407.290,65 | 0,29 |
| 900.000 | TUI CRUISES GMBH 6.500% 15/05/2026 | EUR | 927.000,00 | 0,66 |
| 300.000 | ZF FINANCE GMBH 2.000% 06/05/2027 EMTN | EUR | 301.523,00 | 0,22 |
| 1.000.000 | ZF FINANCE GMBH 2.750% 25/05/2027 EMTN | EUR | 1.036.091,43 | 0,74 |
| | | | **10.880.932,55** | **7,78** |
| | **Italien** | | | |
| 750.000 | ATLANTIA SPA 1.625% 03/02/2025 EMTN | EUR | 768.750,00 | 0,55 |
| 846.000 | ATLANTIA SPA 1.875% 12/02/2028 | EUR | 879.840,00 | 0,63 |
| 350.000 | ATLANTIA SPA 1.875% 13/07/2027 EMTN | EUR | 364.462,19 | 0,26 |
| 500.000 | AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 1.750% 26/06/2026 EMTN | EUR | 516.794,94 | 0,37 |
| 400.000 | AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 1.875% 26/09/2029 EMTN | EUR | 417.424,35 | 0,30 |
| 2.000.000 | AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 2.000% 15/01/2030 | EUR | 2.097.544,72 | 1,49 |
| 500.000 | BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.875% 09/01/2026 | EUR | 502.500,00 | 0,36 |
| 1.000.000 | BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 2.625% 28/04/2025 EMTN | EUR | 1.022.649,72 | 0,73 |
| 500.000 | BANCO BPM SPA FRN PERP | EUR | 527.330,50 | 0,38 |
| 1.500.000 | PRO-GEST SPA 3.250% 15/12/2024 | EUR | 1.463.827,46 | 1,05 |
| 495.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 1.625% 18/01/2029 EMTN | EUR | 485.041,49 | 0,35 |
| 500.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 2.375% 12/10/2027 EMTN | EUR | 517.500,00 | 0,37 |
| 300.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 5.250% 17/03/2055 EMTN | EUR | 364.734,89 | 0,26 |
| 170.000 | VERDE BIDCO SPA 4.625% 01/10/2026 | EUR | 173.077,32 | 0,12 |
| | | | **10.101.477,58** | **7,22** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Jersey** | | | |
| 2.200.000 | ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD 3.500% 15/08/2024 | EUR | 2.217.357,76 | 1,58 |
| 450.000 | AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.125% 15/11/2024 | EUR | 457.649,26 | 0,33 |
| 1.250.000 | AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.750% 30/01/2026 | EUR | 1.277.255,59 | 0,91 |
| 750.000 | WHEEL BIDCO LTD 6.750% 15/07/2026 | GBP | 878.848,32 | 0,63 |
| | | | **4.831.110,93** | **3,45** |
| | **Spanien** | | | |
| 1.200.000 | GRIFOLS ESCROW ISSUER SA 3.875% 15/10/2028 | EUR | 1.214.030,63 | 0,87 |
| 600.000 | INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 0.500% 04/07/2023 | EUR | 588.486,46 | 0,42 |
| 200.000 | INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 2.750% 25/03/2025 | EUR | 201.750,00 | 0,14 |
| 400.000 | INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 3.750% 25/03/2029 | EUR | 405.550,79 | 0,29 |
| 900.000 | LORCA TELECOM BONDCO SA 4.000% 18/09/2027 | EUR | 905.315,05 | 0,65 |
| 475.000 | NH HOTEL GROUP SA 4.000% 02/07/2026 | EUR | 481.257,13 | 0,34 |
| | | | **3.796.390,06** | **2,71** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 1.000.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC/ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP/ATLAS LUXCO 4 SARL 3.625% 01/06/2028 | EUR | 982.561,89 | 0,70 |
| 335.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC/ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP/ATLAS LUXCO 4 SARL 4.875% 01/06/2028 | GBP | 384.006,39 | 0,27 |
| 1.750.000 | ARDAGH PACKAGING FINANCE PLC / ARDAGH HOLDINGS USA INC 2.125% 15/08/2026 | EUR | 1.750.209,07 | 1,25 |
| | | | **3.116.777,35** | **2,22** |
| | **Schweden** | | | |
| 1.159.000 | HEIMSTADEN BOSTAD AB FRN PERP | EUR | 1.130.387,73 | 0,81 |
| 800.000 | SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB FRN PERP | EUR | 800.056,01 | 0,57 |
| 500.000 | VERISURE HOLDING AB 3.250% 15/02/2027 | EUR | 502.528,47 | 0,36 |
| | | | **2.432.972,21** | **1,74** |
| | **Dänemark** | | | |
| 700.000 | DKT FINANCE APS 7.000% 17/06/2023 | EUR | 713.710,52 | 0,51 |
| 1.800.000 | DKT FINANCE APS 9.375% 17/06/2023 | USD | 1.584.824,51 | 1,13 |
| | | | **2.298.535,03** | **1,64** |
| | **Panama** | | | |
| 644.000 | CARNIVAL CORP 10.125% 01/02/2026 | EUR | 740.032,20 | 0,53 |
| 1.000.000 | CARNIVAL CORP 1.875% 07/11/2022 | EUR | 993.034,42 | 0,71 |
| | | | **1.733.066,62** | **1,24** |
| | **Mexiko** | | | |
| 1.120.000 | PETROLEOS MEXICANOS 4.875% 21/02/2028 EMTN | EUR | 1.131.640,44 | 0,81 |
| 500.000 | PETROLEOS MEXICANOS 5.350% 12/02/2028 | USD | 425.344,90 | 0,30 |
| | | | **1.556.985,34** | **1,11** |
| | **Österreich** | | | |
| 600.000 | AMS AG ZCP 05/03/2025 | EUR | 531.461,12 | 0,38 |
| 800.000 | AMS AG 0.875% 28/09/2022 | USD | 676.607,72 | 0,48 |
| 300.000 | AMS AG 6.000% 31/07/2025 | EUR | 320.362,07 | 0,23 |
| | | | **1.528.430,91** | **1,09** |
| | **Griechenland** | | | |
| 1.000.000 | PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA FRN PERP | EUR | 1.017.941,48 | 0,73 |
| | | | **1.017.941,48** | **0,73** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Irland** | | | |
| 670.000 | VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING NOTES III DAC 4.875% 15/07/2028 | GBP | 794.698,18 | 0,57 |
| | | | **794.698,18** | **0,57** |
| | **Portugal** | | | |
| 900.000 | TRANSPORTES AEREOS PORTUGUESES SA 5.625% 02/12/2024 | EUR | 744.470,53 | 0,53 |
| | | | **744.470,53** | **0,53** |
| | **Liberia** | | | |
| 240.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 11.500% 01/06/2025 | USD | 236.429,22 | 0,17 |
| | | | **236.429,22** | **0,17** |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 250.000 | HUARONG UNIVERSE INVESTMENT HOLDING LTD 1.625% 05/12/2022 | EUR | 204.640,13 | 0,15 |
| | | | **204.640,13** | **0,15** |
| | **Südafrika** | | | |
| 9.246.717 | K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 3.000% 31/12/2022 | USD | 7.748,75 | 0,01 |
| 14.695.030 | K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 8.000% 31/12/2022 | EUR | 34.101,87 | 0,02 |
| | | | **41.850,62** | **0,03** |
| | **Kroatien** | | | |
| 983.000 | AGROKOR BOND CONVERTIBLE ZCP 15/07/2031 | EUR | 0,01 | 0,00 |
| | | | **0,01** | **0,00** |
| | | | **131.628.618,20** | **94,07** |

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Aktien

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Südafrika** | | | |
| 109.923.295 | HOLDCO 2 ORDINARY A SHARES | USD | 0,00 | 0,00 |
| 20.560.053 | HOLDCO 2 ORDINARY B SHARES | USD | 0,00 | 0,00 |
| | | | **0,00** | **0,00** |
| | | | **0,00** | **0,00** |

#### Anleihen und andere Schuldtitel

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Luxemburg** | | | |
| 162.859 | HELIX HOLDCO SA 10.000% 19/04/2026 | EUR | 7.317,03 | 0,01 |
| | | | **7.317,03** | **0,01** |
| | **Südafrika** | | | |
| 6.231.816 | K2016470260 SOUTH AFRICA LTD 25.000% 31/12/2022 | USD | 1.024,18 | 0,00 |
| | | | **1.024,18** | **0,00** |
| | | | **8.341,21** | **0,01** |

### Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Offene Fonds

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Luxemburg** | | | |
| 2.440 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 2.417.472,46 | 1,73 |
| | | | **2.417.472,46** | **1,73** |
| | | | **2.417.472,46** | **1,73** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **135.349.849,32** | **96,74** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

#### Devisentermingeschäfte

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 3.025.669,56 | USD | 2.553.132,12 | EUR | 19/10/2021 | 2.553.132,12 | 56.796,66 |
| 626.558.859,00 | JPY | 4.805.175,84 | EUR | 19/10/2021 | 4.805.175,84 | 39.311,47 |
| 80.289.139,00 | JPY | 529.100,45 | GBP | 19/10/2021 | 619.067,73 | 5.389,53 |
| 189.230,99 | USD | 137.330,33 | GBP | 19/10/2021 | 160.368,24 | 3.500,64 |
| 4.680.530,47 | EUR | 4.021.524,78 | GBP | 19/10/2021 | 4.680.530,47 | 3.087,92 |
| 160.034,75 | GBP | 185.104,78 | EUR | 19/10/2021 | 185.104,78 | 1.031,92 |
| 367.389,49 | CHF | 339.143,89 | EUR | 19/10/2021 | 339.143,89 | 708,07 |
| 21.082,99 | USD | 18.000,00 | EUR | 31/12/2021 | 18.000,00 | 154,11 |
| 47.281,04 | CHF | 37.499,52 | GBP | 19/10/2021 | 43.719,04 | 121,35 |
| 11.079,90 | USD | 1.229.239,00 | JPY | 19/10/2021 | 9.463,13 | 53,12 |
| 21.034,52 | GBP | 3.160.079,00 | JPY | 19/10/2021 | 24.388,76 | 31,89 |
| 1.492,82 | GBP | 1.869,43 | CHF | 19/10/2021 | 1.730,87 | 6,99 |
| 665,73 | USD | 618,99 | CHF | 19/10/2021 | 570,30 | 1,66 |
| 19.859,00 | JPY | 165,00 | CHF | 19/10/2021 | 153,13 | 0,92 |
| 1.400,64 | EUR | 1.517,35 | CHF | 19/10/2021 | 1.400,64 | (2,97) |
| 556,30 | CHF | 608,32 | USD | 19/10/2021 | 514,45 | (10,13) |
| 12.119,84 | EUR | 1.581.110,00 | JPY | 19/10/2021 | 12.119,84 | (105,13) |
| 1.130.982,00 | JPY | 10.269,79 | USD | 19/10/2021 | 8.703,10 | (114,04) |
| 18.119,24 | GBP | 24.781,23 | USD | 19/10/2021 | 21.163,92 | (301,66) |
| 194.506,72 | EUR | 228.972,99 | USD | 19/10/2021 | 194.506,72 | (3.004,34) |
| 5.993.000,00 | GBP | 6.963.194,41 | EUR | 31/12/2021 | 6.963.194,41 | (3.313,89) |
| 10.590.673,25 | EUR | 12.399.000,00 | USD | 31/12/2021 | 10.590.673,25 | (85.841,86) |
| | | | | | **31.232.824,63** | **17.502,23** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **17.502,23** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **135.349.849,32** | **96,74** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **17.502,23** | **0,01** |
| **Bankguthaben** | **3.930.336,39** | **2,81** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **610.821,37** | **0,44** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **139.908.509,31** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Participation Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 1.866.523,00 |
| | 30.09.2020 | EUR | 34.192.768,73 |
| | 30.09.2019 | EUR | 89.994.378,78 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 3.460,93 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.236,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.764,86 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 31,49 |
| | 30.09.2020 | EUR | 20,59 |
| | 30.09.2019 | EUR | 25,70 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 27,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 18,08 |
| | 30.09.2019 | EUR | 22,79 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 2 |
| | 30.09.2020 | | 14.621 |
| | 30.09.2019 | | 31.731 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 56.779 |
| | 30.09.2020 | | 69.485 |
| | 30.09.2019 | | 84.003 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 2.642 |
| | 30.09.2020 | | 3.112 |
| | 30.09.2019 | | 4.548 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,80% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 1,80% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 1,80% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 131,46% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European Participation Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **1.787.723,37** |
| Aktien | | 1.787.723,37 |
| **Bankguthaben** | | **17.866,38** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **72.934,43** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***1.878.524,18*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(12.001,18)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(12.001,18)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.866.523,00*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **73.827,76** |
| Dividenden | | 73.827,76 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(72.059,75)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (51.736,76) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (12.735,09) |
| Abonnementsteuer | 9 | (921,95) |
| Bankzinsen | | (6.665,95) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **1.768,01** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 2.992.259,61 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (11.662.891,42) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 56.463,17 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (40.039,97) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 12.796.396,83 |
| **Ergebnis** | | **4.143.956,23** |
| Zeichnungen | | 3.955,39 |
| Rücknahmen | | (36.474.157,35) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 34.192.768,73 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.866.523,00*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Participation Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

**Vereinigtes Königreich**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 549 | DECHRA PHARMACEUTICALS PLC | GBP | 30.977,90 | 1,66 |
| 17.913 | ELEMENTIS PLC | GBP | 31.052,21 | 1,67 |
| 3.451 | HEADLAM GROUP PLC | GBP | 19.753,68 | 1,06 |
| 2.465 | HOWDEN JOINERY GROUP PLC | GBP | 25.690,11 | 1,38 |
| 9.151 | JOHN WOOD GROUP PLC | GBP | 24.497,57 | 1,31 |
| 10.865 | KIN & CARTA PLC | GBP | 34.761,65 | 1,86 |
| 16.837 | MCBRIDE PLC | GBP | 14.769,78 | 0,79 |
| 6.571 | REDROW PLC | GBP | 51.037,07 | 2,73 |
| 3.813 | RENEWI PLC | GBP | 26.882,98 | 1,44 |
| 4.098 | RICARDO PLC | GBP | 20.262,77 | 1,09 |
| 9.678 | TT ELECTRONICS PLC | GBP | 29.218,70 | 1,57 |
| 1.479 | UNITE GROUP PLC | GBP | 18.721,26 | 1,00 |
| 1.833 | WEIR GROUP PLC/THE | GBP | 36.072,19 | 1,93 |
| | | | **363.697,87** | **19,49** |

**Niederlande**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 654 | ACCELL GROUP NV | EUR | 25.080,90 | 1,34 |
| 634 | AMG ADVANCED METALLURGICAL GROUP NV | EUR | 17.739,32 | 0,95 |
| 992 | ARCADIS NV | EUR | 42.834,56 | 2,30 |
| 709 | ASR NEDERLAND NV | EUR | 28.019,68 | 1,50 |
| 186 | EURONEXT NV | EUR | 18.172,20 | 0,97 |
| 951 | KENDRION NV | EUR | 20.494,05 | 1,10 |
| 550 | NEDAP NV | EUR | 32.175,00 | 1,72 |
| 850 | NX FILTRATION NV | EUR | 9.724,00 | 0,52 |
| 681 | RHI MAGNESITA NV | GBP | 25.971,32 | 1,39 |
| 1.121 | TKH GROUP NV - DUTCH CERT | EUR | 54.211,56 | 2,91 |
| | | | **274.422,59** | **14,70** |

**Frankreich**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 231 | ALTEN SA | EUR | 29.360,10 | 1,57 |
| 500 | ANTIN INFRASTRUCTURE PARTNERS SA | EUR | 14.550,00 | 0,78 |
| 174 | GAZTRANSPORT ET TECHNIGAZ SA | EUR | 11.266,50 | 0,60 |
| 1.281 | IPSOS | EUR | 50.407,35 | 2,70 |
| 1.009 | LECTRA | EUR | 34.255,55 | 1,84 |
| 1.160 | QUADIENT SA | EUR | 24.128,00 | 1,29 |
| 1.584 | REXEL SA | EUR | 26.555,76 | 1,43 |
| 745 | RUBIS SCA | EUR | 22.268,05 | 1,19 |
| 322 | VERALLIA SA | EUR | 9.595,60 | 0,51 |
| | | | **222.386,91** | **11,91** |

**Deutschland**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 459 | DUERR AG | EUR | 17.083,98 | 0,92 |
| 199 | MORPHOSYS AG | EUR | 8.159,00 | 0,44 |
| 2.186 | PROSIEBENSAT.1 MEDIA SE | EUR | 34.669,96 | 1,86 |
| 2.345 | SAF-HOLLAND SE | EUR | 27.272,35 | 1,46 |
| 899 | SOFTWARE AG | EUR | 36.247,68 | 1,94 |
| 1.028 | TAG IMMOBILIEN AG | EUR | 26.028,96 | 1,39 |
| 1.185 | TAKKT AG | EUR | 16.258,20 | 0,87 |
| 301 | VERBIO VEREINIGTE BIOENERGIE AG | EUR | 17.126,90 | 0,92 |
| | | | **182.847,03** | **9,80** |

**Italien**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 8.165 | ANIMA HOLDING SPA | EUR | 33.762,28 | 1,81 |
| 12.002 | BPER BANCA | EUR | 23.199,87 | 1,25 |
| 2.534 | EL.EN. SPA | EUR | 35.881,44 | 1,92 |
| 633 | INTERPUMP GROUP SPA | EUR | 35.448,00 | 1,90 |
| 1.124 | MARR SPA | EUR | 23.761,36 | 1,27 |
| | | | **152.052,95** | **8,15** |

**Belgien**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 267 | AEDIFICA SA | EUR | 28.782,60 | 1,54 |
| 628 | BARCO NV | EUR | 11.775,00 | 0,63 |
| 786 | BEKAERT SA | EUR | 28.280,28 | 1,52 |
| 305 | D'IETEREN GROUP | EUR | 38.735,00 | 2,08 |
| 1.851 | FAGRON | EUR | 31.281,90 | 1,67 |
| 134 | XIOR STUDENT HOUSING NV | EUR | 6.532,50 | 0,35 |
| | | | **145.387,28** | **7,79** |

**Österreich**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 615 | BAWAG GROUP AG | EUR | 33.855,75 | 1,81 |
| 166 | LENZING AG | EUR | 17.430,00 | 0,93 |
| 635 | PALFINGER AG | EUR | 23.907,75 | 1,28 |
| 771 | POLYTEC HOLDING AG | EUR | 6.437,85 | 0,35 |
| 712 | WIENERBERGER AG | EUR | 20.747,68 | 1,12 |
| | | | **102.379,03** | **5,49** |

**Luxemburg**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 384 | APERAM SA | EUR | 18.385,92 | 0,99 |
| 672 | BEFESA SA | EUR | 44.284,80 | 2,37 |
| 368 | STABILUS SA | EUR | 22.282,40 | 1,19 |
| | | | **84.953,12** | **4,55** |

**Spanien**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 5.209 | BANKINTER SA | EUR | 26.399,21 | 1,41 |
| 605 | CONSTRUCCIONES Y AUXILIAR DE FERROCARRILES SA | EUR | 21.749,75 | 1,17 |
| 3.838 | LINEA DIRECTA ASEGURADORA SA CIA DE SEGUROS Y REASEGUROS | EUR | 6.536,11 | 0,35 |
| 4.517 | TALGO SA | EUR | 20.213,58 | 1,08 |
| | | | **74.898,65** | **4,01** |

**Bermuda**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2.813 | HISCOX LTD | GBP | 27.477,68 | 1,47 |
| 4.830 | LANCASHIRE HOLDINGS LTD | GBP | 31.636,86 | 1,70 |
| | | | **59.114,54** | **3,17** |

**Schweden**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1.111 | ALIMAK GROUP AB | SEK | 14.420,13 | 0,77 |
| 1.728 | FABEGE AB | SEK | 22.581,81 | 1,21 |
| | | | **37.001,94** | **1,98** |

**Irland**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2.241 | GLANBIA PLC | EUR | 31.911,84 | 1,71 |
| | | | **31.911,84** | **1,71** |

**Dänemark**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 306 | SCHOUW & CO AS | DKK | 25.431,62 | 1,36 |
| | | | **25.431,62** | **1,36** |

**Norwegen**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 756 | BORREGAARD ASA | NOK | 15.879,58 | 0,85 |
| | | | **15.879,58** | **0,85** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Participation Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Schweiz** | | | |
| 808 | SOFTWAREONE HOLDING AG | CHF | 15.358,42 | 0,82 |
| | | | **15.358,42** | **0,82** |
| | | | **1.787.723,37** | **95,78** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **1.787.723,37** | **95,78** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **1.787.723,37** | **95,78** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **0,00** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **17.866,38** | **0,96** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **60.933,25** | **3,26** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **1.866.523,00** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 166.015.606,94 |
| | 30.09.2020 | EUR | 149.774.324,26 |
| | 30.09.2019 | EUR | 180.399.686,67 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.453,48 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.224,09 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.469,82 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.325,51 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.119,23 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.347,37 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.247,93 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.060,58 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.285,12 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 271,68 |
| | 30.09.2020 | EUR | 229,35 |
| | 30.09.2019 | EUR | 276,10 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.124,37 |
| | 30.09.2020 | EUR | 960,34 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.169,49 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 28.461,46 |
| | 30.09.2020 | CZK | 24.255,59 |
| | 30.09.2019 | CZK | 29.753,92 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 8.732,80 |
| | 30.09.2019 | EUR | 10.435,65 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.551,89 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.608,99 |
| | 30.09.2019 | EUR | 8.245,01 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.697,01 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.382,08 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.999,09 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 241,10 |
| | 30.09.2020 | EUR | 211,50 |
| | 30.09.2019 | EUR | 264,56 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 60.478 |
| | 30.09.2020 | | 29.331 |
| | 30.09.2019 | | 25.705 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 1.445 |
| | 30.09.2020 | | 1.360 |
| | 30.09.2019 | | 1.462 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 36.508 |
| | 30.09.2020 | 38.141 |
| | 30.09.2019 | 41.609 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 5.487 |
| | 30.09.2020 | 6.897 |
| | 30.09.2019 | 7.710 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 5.629 |
| | 30.09.2020 | 6.663 |
| | 30.09.2019 | 6.470 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2.965 |
| | 30.09.2020 | 2.717 |
| | 30.09.2019 | 2.911 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 1.124 |
| | 30.09.2019 | 991 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 2.101 |
| | 30.09.2020 | 7.169 |
| | 30.09.2019 | 7.029 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 937 |
| | 30.09.2020 | 1.123 |
| | 30.09.2019 | 1.163 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 4.518 |
| | 30.09.2020 | 7.635 |
| | 30.09.2019 | 8.867 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Dividende** | | | |
| Distribution I (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 264,35 |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 95,30 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 8,45 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,93% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,10% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,12% |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,93% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 33,41% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **165.073.660,51** |
| Aktien | | 165.073.660,51 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **6.359,93** |
| Devisentermingeschäfte | | 6.359,93 |
| **Bankguthaben** | | **4.133.639,17** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **7.169.554,04** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***176.383.213,65*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(10.367.606,71)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(10.367.606,71)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***166.015.606,94*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **3.791.039,87** |
| Dividenden | | 3.791.039,87 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.608.372,25)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.221.715,50) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (330.944,02) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (598,38) |
| Abonnementsteuer | 9 | (38.411,64) |
| Bankzinsen | | (16.702,71) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **2.182.667,62** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 26.478.687,84 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (12.835.923,43) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 105.382,84 |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 834.199,54 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (807.111,55) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 4.946.948,49 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 84.136,58 |
| **Ergebnis** | | **20.988.987,93** |
| Zeichnungen | | 291.494.624,29 |
| Rücknahmen | | (294.188.878,21) |
| Ausschüttung | | (2.053.451,33) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 149.774.324,26 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***166.015.606,94*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Deutschland** | | | | |
| 222.085 | ALSTRIA OFFICE REIT-AG | EUR | 3.488.955,35 | 2,10 |
| 115.718 | DEUTSCHE WOHNEN SE | EUR | 6.123.796,56 | 3,69 |
| 89.633 | LEG IMMOBILIEN SE | EUR | 10.953.152,60 | 6,60 |
| 253.293 | TAG IMMOBILIEN AG | EUR | 6.413.378,76 | 3,86 |
| 312.442 | VONOVIA SE | EUR | 16.215.739,80 | 9,77 |
| | | | **43.195.023,07** | **26,02** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 67.764 | BIG YELLOW GROUP PLC | GBP | 1.099.793,52 | 0,66 |
| 239.090 | BRITISH LAND CO PLC/THE | GBP | 1.377.463,06 | 0,83 |
| 78.536 | DERWENT LONDON PLC | GBP | 3.159.596,92 | 1,90 |
| 582.539 | GRAINGER PLC | GBP | 2.067.106,06 | 1,25 |
| 24.433 | GREAT PORTLAND ESTATES PLC | GBP | 212.199,59 | 0,13 |
| 506.600 | HAMMERSON PLC | GBP | 190.608,87 | 0,11 |
| 61.271 | LAND SECURITIES GROUP PLC | GBP | 496.850,42 | 0,30 |
| 27.553 | LXI REIT PLC | GBP | 44.044,69 | 0,03 |
| 1.397.652 | PRIMARY HEALTH PROPERTIES PLC | GBP | 2.453.726,79 | 1,48 |
| 57.280 | SAFESTORE HOLDINGS PLC | GBP | 699.063,15 | 0,42 |
| 836.577 | SEGRO PLC | GBP | 11.630.857,64 | 7,01 |
| 337.285 | SHAFTESBURY PLC | GBP | 2.387.786,68 | 1,44 |
| 1.951.119 | TRITAX BIG BOX REIT PLC | GBP | 4.825.973,49 | 2,90 |
| 237.492 | UNITE GROUP PLC | GBP | 3.006.185,63 | 1,81 |
| | | | **33.651.256,51** | **20,27** |
| **Schweden** | | | | |
| 358.170 | CASTELLUM AB | SEK | 7.577.321,49 | 4,56 |
| 310.264 | FABEGE AB | SEK | 4.054.585,62 | 2,44 |
| 6.121 | FASTIGHETS AB BALDER - B | SEK | 318.633,16 | 0,19 |
| 16.668 | HUFVUDSTADEN AB - A | SEK | 215.518,92 | 0,13 |
| 273.152 | KUNGSLEDEN AB | SEK | 3.111.613,02 | 1,87 |
| 17.101 | SAGAX AB - B | SEK | 461.800,25 | 0,28 |
| 1.564.560 | SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB | SEK | 7.480.903,36 | 4,52 |
| 75.572 | WIHLBORGS FASTIGHETER AB | SEK | 1.299.890,01 | 0,78 |
| | | | **24.520.265,83** | **14,77** |
| **Frankreich** | | | | |
| 62.787 | COVIVIO | EUR | 4.572.149,34 | 2,75 |
| 51.103 | GECINA SA | EUR | 5.956.054,65 | 3,59 |
| 44.823 | ICADE | EUR | 3.041.240,55 | 1,83 |
| 54.700 | KLEPIERRE SA | EUR | 1.063.368,00 | 0,64 |
| 184.140 | MERCIALYS SA | EUR | 1.695.929,40 | 1,03 |
| | | | **16.328.741,94** | **9,84** |
| **Schweiz** | | | | |
| 8.671 | ALLREAL HOLDING AG | CHF | 1.483.762,50 | 0,89 |
| 44.909 | PSP SWISS PROPERTY AG - REG | CHF | 4.677.300,26 | 2,82 |
| 72.144 | SWISS PRIME SITE AG - REG | CHF | 6.099.158,07 | 3,67 |
| | | | **12.260.220,83** | **7,38** |
| **Belgien** | | | | |
| 34.950 | AEDIFICA SA | EUR | 3.767.610,00 | 2,27 |
| 30.091 | COFINIMMO SA | EUR | 3.941.921,00 | 2,37 |
| 70.750 | WAREHOUSES DE PAUW CVA | EUR | 2.476.250,00 | 1,50 |
| 400 | XIOR STUDENT HOUSING NV | EUR | 19.500,00 | 0,01 |
| | | | **10.205.281,00** | **6,15** |
| **Luxemburg** | | | | |
| 2.600 | ADLER GROUP SA | EUR | 38.220,00 | 0,02 |
| 1.339.686 | AROUNDTOWN SA | EUR | 7.997.925,42 | 4,82 |
| 26.153 | GRAND CITY PROPERTIES SA | EUR | 563.335,62 | 0,34 |
| 17.200 | SHURGARD SELF STORAGE SA | EUR | 814.420,00 | 0,49 |
| | | | **9.413.901,04** | **5,67** |
| **Supranational-Multinational** | | | | |
| 99.276 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | EUR | 6.315.939,12 | 3,80 |
| | | | **6.315.939,12** | **3,80** |
| **Spanien** | | | | |
| 127.542 | INMOBILIARIA COLONIAL SOCIMI SA | EUR | 1.068.801,96 | 0,64 |
| 460.903 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA | EUR | 4.089.131,42 | 2,47 |
| | | | **5.157.933,38** | **3,11** |
| **Österreich** | | | | |
| 105.887 | IMMOFINANZ AG | EUR | 2.181.272,20 | 1,31 |
| | | | **2.181.272,20** | **1,31** |
| **Finnland** | | | | |
| 30.529 | CITYCON OYJ | EUR | 211.565,97 | 0,13 |
| 66.793 | KOJAMO OYJ | EUR | 1.196.262,63 | 0,72 |
| | | | **1.407.828,60** | **0,85** |
| **Niederlande** | | | | |
| 4.369 | CTP NV | EUR | 82.137,20 | 0,05 |
| 16.977 | EUROCOMMERCIAL PROPERTIES NV | EUR | 313.123,79 | 0,19 |
| 1.273 | NSI NV | EUR | 40.736,00 | 0,02 |
| | | | **435.996,99** | **0,26** |
| | | | **165.073.660,51** | **99,43** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **165.073.660,51** | **99,43** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 91.434.999,30 | CZK | 3.597.759,36 | EUR | 19/10/2021 | 3.597.759,36 | 7.139,86 |
| 198.213,28 | EUR | 5.047.282,40 | CZK | 19/10/2021 | 198.213,28 | (779,93) |
| | | | | | **3.795.972,64** | **6.359,93** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **6.359,93** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **165.073.660,51** | **99,43** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **6.359,93** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **4.133.639,17** | **2,49** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(3.198.052,67)** | **(1,92)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **166.015.606,94** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 619.815.167,41 |
| | 30.09.2020 | EUR | 480.573.671,27 |
| | 30.09.2019 | EUR | 390.123.937,98 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 10.844,54 |
| | 30.09.2020 | EUR | 8.779,78 |
| | 30.09.2019 | EUR | 7.664,59 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.754,66 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.362,60 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.519,50 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 530,00 |
| | 30.09.2020 | EUR | 429,70 |
| | 30.09.2019 | EUR | 375,64 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 503,32 |
| | 30.09.2020 | EUR | 411,57 |
| | 30.09.2019 | EUR | 362,87 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 9.142,76 |
| | 30.09.2020 | CZK | 7.451,36 |
| | 30.09.2019 | CZK | 6.600,00 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 378,18 |
| | 30.09.2020 | EUR | 306,89 |
| | 30.09.2019 | EUR | 268,58 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 540,96 |
| | 30.09.2020 | EUR | 444,56 |
| | 30.09.2019 | EUR | 393,91 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 243,10 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 11.958,81 |
| | 30.09.2020 | EUR | 9.612,65 |
| | 30.09.2019 | EUR | 8.331,58 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.917,19 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 272,83 |
| | 30.09.2020 | EUR | 221,63 |
| | 30.09.2019 | EUR | 195,43 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 267,64 |
| | 30.09.2020 | EUR | 218,85 |
| | 30.09.2019 | EUR | 193,24 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 256,00 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 18.667 |
| | 30.09.2020 | 32.306 |
| | 30.09.2019 | 33.724 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 4.162 |
| | 30.09.2020 | 4.161 |
| | 30.09.2019 | 4.161 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 7.316 |
| | 30.09.2020 | 4.950 |
| | 30.09.2019 | 5.753 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 180.968 |
| | 30.09.2020 | 61.649 |
| | 30.09.2019 | 44.325 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2.528 |
| | 30.09.2020 | 475 |
| | 30.09.2019 | 0.27 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 6.110 |
| | 30.09.2020 | 27.421 |
| | 30.09.2019 | 2.156 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 39.102 |
| | 30.09.2020 | 19.678 |
| | 30.09.2019 | 19.919 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1.516 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 15.699 |
| | 30.09.2020 | 9.310 |
| | 30.09.2019 | 5.124 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 4.924 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 116.805 |
| | 30.09.2020 | 131.359 |
| | 30.09.2019 | 195.033 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 62.438 |
| | 30.09.2020 | 28.539 |
| | 30.09.2019 | 6.188 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 3.174 |
| | 30.09.2019 | - |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution N (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,45 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,45 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,04% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,09% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 0,01% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (29,10%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) European Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **619.536.566,34** |
| Aktien | | 606.917.448,81 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 12.619.117,53 |
| **Bankguthaben** | | **615.610,52** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **1.578.954,90** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***621.731.131,76*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(1.860.992,32)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(54.972,03)** |
| Devisentermingeschäfte | | (54.972,03) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(1.915.964,35)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***619.815.167,41*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **9.650.036,09** |
| Dividenden | | 9.618.021,44 |
| Sonstige Erträge | 10 | 32.014,65 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(4.384.495,00)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (3.290.360,86) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (968.176,71) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (6.402,25) |
| Abonnementsteuer | 9 | (115.480,46) |
| Bankzinsen | | (4.074,72) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **5.265.541,09** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 74.720.900,80 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (7.016.892,48) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 3.607,37 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (236.323,75) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 1.136.054,32 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.030.638,50) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 41.416.797,34 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (137.499,76) |
| **Ergebnis** | | **114.121.546,43** |
| Zeichnungen | | 463.760.357,49 |
| Rücknahmen | | (438.575.470,59) |
| Ausschüttung | | (64.937,19) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 480.573.671,27 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***619.815.167,41*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Schweiz** | | | | |
| 340.891 | NESTLE SA - REG | CHF | 35.535.540,60 | 5,74 |
| 13.177 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 17.874.013,78 | 2,88 |
| 48.343 | ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN | CHF | 15.290.429,37 | 2,47 |
| 10.884 | STRAUMANN HOLDING AG - REG | CHF | 16.948.260,44 | 2,73 |
| 13.992 | TECAN GROUP AG | CHF | 6.878.702,72 | 1,11 |
| 45.390 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 16.105.056,64 | 2,60 |
| | | | **108.632.003,55** | **17,53** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 504.791 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 8.950.235,95 | 1,44 |
| 256.294 | DECHRA PHARMACEUTICALS PLC | GBP | 14.461.658,18 | 2,33 |
| 812.842 | HOMESERVE PLC | GBP | 8.553.672,56 | 1,38 |
| 1.390.173 | NATIONAL GRID PLC | GBP | 14.307.168,72 | 2,30 |
| 332.156 | PRUDENTIAL PLC | GBP | 5.622.675,37 | 0,91 |
| 683.274 | RELX PLC | EUR | 17.081.850,00 | 2,76 |
| 1.313.864 | RWS HOLDINGS PLC | GBP | 9.576.557,11 | 1,54 |
| 172.197 | UNILEVER PLC | EUR | 8.032.129,07 | 1,30 |
| 1.048.140 | 3I GROUP PLC | GBP | 15.627.007,48 | 2,52 |
| | | | **102.212.954,44** | **16,48** |
| **Deutschland** | | | | |
| 54.098 | ADIDAS AG | EUR | 14.703.836,40 | 2,37 |
| 83.540 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 16.276.933,60 | 2,63 |
| 98.553 | CONTINENTAL AG | EUR | 9.341.838,87 | 1,51 |
| 116.568 | HELLOFRESH SE | EUR | 9.320.777,28 | 1,50 |
| 124.902 | SAP SE | EUR | 14.598.545,76 | 2,35 |
| 94.701 | SCOUT24 AG | EUR | 5.678.271,96 | 0,92 |
| 123.845 | SIEMENS AG - REG | EUR | 17.576.082,40 | 2,84 |
| 153.120 | TEAMVIEWER AG | EUR | 3.887.716,80 | 0,62 |
| 19.710 | VITESCO TECHNOLOGIES GROUP AG | EUR | 1.005.210,00 | 0,16 |
| 80.976 | ZALANDO SE | EUR | 6.423.016,32 | 1,04 |
| | | | **98.812.229,39** | **15,94** |
| **Frankreich** | | | | |
| 173.674 | AMUNDI SA | EUR | 12.660.834,60 | 2,04 |
| 84.807 | ESSILORLUXOTTICA SA | EUR | 14.035.558,50 | 2,26 |
| 12.033 | KERING SA | EUR | 7.412.328,00 | 1,20 |
| 60.364 | L'OREAL SA | EUR | 21.540.893,40 | 3,48 |
| 127.799 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 18.390.276,10 | 2,97 |
| | | | **74.039.890,60** | **11,95** |
| **Niederlande** | | | | |
| 6.040 | ADYEN NV | EUR | 14.586.600,00 | 2,35 |
| 48.141 | ASML HOLDING NV | EUR | 31.094.271,90 | 5,02 |
| 134.859 | EURONEXT NV | EUR | 13.175.724,30 | 2,13 |
| | | | **58.856.596,20** | **9,50** |
| **Schweden** | | | | |
| 593.628 | ASSA ABLOY AB - B | SEK | 14.970.776,13 | 2,42 |
| 297.864 | ATLAS COPCO AB - A | SEK | 15.634.791,65 | 2,52 |
| 1.294.041 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB - A | SEK | 12.548.422,05 | 2,02 |
| | | | **43.153.989,83** | **6,96** |
| **Dänemark** | | | | |
| 305.977 | NOVO NORDISK AS - B | DKK | 25.569.615,56 | 4,12 |
| 149.687 | NOVOZYMES AS - B | DKK | 8.857.291,30 | 1,43 |
| | | | **34.426.906,86** | **5,55** |
| **Spanien** | | | | |
| 218.820 | CELLNEX TELECOM SA | EUR | 11.663.106,00 | 1,88 |
| 252.344 | GRUPO CATALANA OCCIDENTE SA | EUR | 7.948.836,00 | 1,28 |
| 349.869 | SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA | EUR | 7.704.115,38 | 1,25 |
| | | | **27.316.057,38** | **4,41** |
| **Irland** | | | | |
| 59.462 | LINDE PLC | EUR | 15.228.218,20 | 2,46 |
| | | | **15.228.218,20** | **2,46** |
| **Färöer-Inseln** | | | | |
| 173.680 | BAKKAFROST P/F | NOK | 12.429.301,61 | 2,01 |
| | | | **12.429.301,61** | **2,01** |
| **Norwegen** | | | | |
| 231.723 | NORDIC SEMICONDUCTOR ASA | NOK | 6.014.814,17 | 0,97 |
| 129.033 | TOMRA SYSTEMS ASA | NOK | 5.832.575,19 | 0,94 |
| | | | **11.847.389,36** | **1,91** |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 46.270 | SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | USD | 10.588.661,63 | 1,71 |
| | | | **10.588.661,63** | **1,71** |
| **Finnland** | | | | |
| 191.408 | NESTE OYJ | EUR | 9.373.249,76 | 1,51 |
| | | | **9.373.249,76** | **1,51** |
| | | | **606.917.448,81** | **97,92** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| **Luxemburg** | | | | |
| 12.738 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 12.619.117,53 | 2,04 |
| | | | **12.619.117,53** | **2,04** |
| | | | **12.619.117,53** | **2,04** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **619.536.566,34** | **99,96** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 4.152.738,09 | EUR | 3.567.855,37 | GBP | 19/10/2021 | 4.152.738,09 | 2.959,23 |
| 25.044.579,26 | CZK | 985.388,15 | EUR | 19/10/2021 | 985.388,15 | 2.014,76 |
| 175.708,83 | USD | 150.271,48 | EUR | 19/10/2021 | 150.271,48 | 1.294,14 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) European Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 314.905,67 | CHF | 290.499,37 | EUR | 19/10/2021 | 290.499,37 | 802,68 |
| 1.921.832,52 | EUR | 14.285.986,21 | DKK | 19/10/2021 | 1.921.832,52 | 663,95 |
| 1.772.217,22 | SEK | 174.318,33 | EUR | 19/10/2021 | 174.318,33 | 439,40 |
| 775.410,99 | NOK | 76.238,09 | EUR | 19/10/2021 | 76.238,09 | 376,64 |
| 58,31 | EUR | 1.487,50 | CZK | 01/10/2021 | 58,31 | (0,38) |
| 987.681,78 | DKK | 132.860,00 | EUR | 19/10/2021 | 132.860,00 | (37,30) |
| 77.852,19 | EUR | 1.986.773,46 | CZK | 19/10/2021 | 77.852,19 | (477,97) |
| 6.032.693,44 | EUR | 6.535.126,31 | CHF | 19/10/2021 | 6.032.693,44 | (12.595,22) |
| 683.311,15 | EUR | 809.474,31 | USD | 19/10/2021 | 683.311,15 | (14.937,70) |
| 2.469.173,81 | EUR | 25.191.619,86 | SEK | 19/10/2021 | 2.469.173,81 | (14.963,09) |
| 1.372.326,37 | EUR | 14.096.787,57 | NOK | 19/10/2021 | 1.372.326,37 | (20.511,17) |
| | | | | | **18.519.561,30** | **(54.972,03)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(54.972,03)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **619.536.566,34** | **99,96** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(54.972,03)** | **(0,01)** |
| **Bankguthaben** | **615.610,52** | **0,10** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(282.037,42)** | **(0,05)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **619.815.167,41** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 824.586.642,98 |
| | 30.09.2020 | EUR | 848.172.803,31 |
| | 30.09.2019 | EUR | 991.135.103,18 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.772,31 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.382,04 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.416,80 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 150.666,29 |
| | 30.09.2020 | CZK | 141.333,80 |
| | 30.09.2019 | CZK | 141.108,21 |
| Capitalisation I Hedged (i) (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 577.146,48 |
| | 30.09.2020 | HUF | 537.624,39 |
| | 30.09.2019 | HUF | 537.793,24 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 28.067,96 |
| | 30.09.2020 | PLN | 26.307,32 |
| | 30.09.2019 | PLN | 26.156,74 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.783,61 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.400,50 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.319,30 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 27,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 25,55 |
| | 30.09.2019 | EUR | 25,72 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 27,28 |
| | 30.09.2020 | EUR | 25,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 25,79 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 294,03 |
| | 30.09.2020 | EUR | 278,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 281,89 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 545,83 |
| | 30.09.2020 | CZK | 514,93 |
| | 30.09.2019 | CZK | 517,92 |
| Capitalisation P Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.246,71 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.170,93 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.160,44 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 281,24 |
| | 30.09.2019 | EUR | 283,02 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 289,01 |
| | 30.09.2020 | EUR | 275,34 |
| | 30.09.2019 | EUR | 279,86 |
| Capitalisation X Hedged (i) (RON) | 30.09.2021 | RON | 1.147,58 |
| | 30.09.2020 | RON | 1.070,99 |
| | 30.09.2019 | RON | 1.055,30 |
| Capitalisation X Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 284,93 |
| | 30.09.2020 | USD | 269,01 |
| | 30.09.2019 | USD | 268,12 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.257,20 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.594,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.238,09 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.232,50 |
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 30.09.2021 | JPY | 10.592,00 |
| | 30.09.2020 | JPY | 10.060,00 |
| | 30.09.2019 | JPY | 10.203,00 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 266,85 |
| | 30.09.2020 | EUR | 256,14 |
| | 30.09.2019 | EUR | 262,47 |
| Distribution P Hedged (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 254,39 |
| | 30.09.2019 | USD | 255,63 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 271,79 |
| | 30.09.2020 | EUR | 259,57 |
| | 30.09.2019 | EUR | 264,64 |
| Distribution R Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 272,26 |
| | 30.09.2020 | USD | 257,83 |
| | 30.09.2019 | USD | 257,52 |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 261,19 |
| | 30.09.2020 | EUR | 251,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 259,48 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 204,57 |
| | 30.09.2020 | AUD | 204,63 |
| | 30.09.2019 | AUD | 217,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 212,45 |
| | 30.09.2020 | USD | 211,29 |
| | 30.09.2019 | USD | 221,70 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 192,02 |
| | 30.09.2020 | AUD | 194,12 |
| | 30.09.2019 | AUD | 208,64 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 198,98 |
| | 30.09.2020 | USD | 200,38 |
| | 30.09.2019 | USD | 212,39 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 63.317 |
| | 30.09.2020 | | 71.028 |
| | 30.09.2019 | | 75.131 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2.747 |
| | 30.09.2020 | 2.713 |
| | 30.09.2019 | 2.678 |
| Capitalisation I Hedged (i) (HUF) | 30.09.2021 | 7.002 |
| | 30.09.2020 | 6.111 |
| | 30.09.2019 | 5.017 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 4.093 |
| | 30.09.2020 | 4.212 |
| | 30.09.2019 | 6.370 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 0,51 |
| | 30.09.2020 | 9 |
| | 30.09.2019 | 9 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 12.489 |
| | 30.09.2020 | 15.223 |
| | 30.09.2019 | 18.481 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 58.152 |
| | 30.09.2020 | 59.588 |
| | 30.09.2019 | 470.419 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 67.243 |
| | 30.09.2020 | 103.629 |
| | 30.09.2019 | 146.300 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 872.914 |
| | 30.09.2020 | 1.070.101 |
| | 30.09.2019 | 1.268.077 |
| Capitalisation P Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 270 |
| | 30.09.2020 | 776 |
| | 30.09.2019 | 808 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 300 |
| | 30.09.2019 | 500 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 25.934 |
| | 30.09.2020 | 30.541 |
| | 30.09.2019 | 49.978 |
| Capitalisation X Hedged (i) (RON) | 30.09.2021 | 3.249 |
| | 30.09.2020 | 2.993 |
| | 30.09.2019 | 5.749 |
| Capitalisation X Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 2.906 |
| | 30.09.2020 | 7.924 |
| | 30.09.2019 | 5.866 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 3.376 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |

| Anzahl der Anteile | | |
|---|---|---|
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 41.052 |
| | 30.09.2020 | 44.586 |
| | 30.09.2019 | 50.163 |
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 30.09.2021 | 256.623 |
| | 30.09.2020 | 309.380 |
| | 30.09.2019 | 603.145 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 3.471 |
| | 30.09.2020 | 4.344 |
| | 30.09.2019 | 7.540 |
| Distribution P Hedged (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 204 |
| | 30.09.2019 | 204 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 2.292 |
| | 30.09.2020 | 5.097 |
| | 30.09.2019 | 5.852 |
| Distribution R Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 49 |
| | 30.09.2020 | 49 |
| | 30.09.2019 | 49 |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | 2.465 |
| | 30.09.2020 | 3.919 |
| | 30.09.2019 | 8.158 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 29.530 |
| | 30.09.2020 | 37.170 |
| | 30.09.2019 | 36.376 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 57.776 |
| | 30.09.2020 | 58.782 |
| | 30.09.2019 | 61.259 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 8.384 |
| | 30.09.2020 | 13.648 |
| | 30.09.2019 | 26.105 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 43.626 |
| | 30.09.2020 | 30.837 |
| | 30.09.2019 | 51.556 |

| Dividende | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 31.08.2021 | JPY | 66,00 |
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 26.02.2021 | JPY | 63,00 |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 3,25 |
| Distribution P Hedged (USD) | 14.12.2020 | USD | 3,20 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 3,30 |
| Distribution R Hedged (i) (USD) | 14.12.2020 | USD | 3,25 |
| Distribution X (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 3,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 0,92 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 07.04.2021 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,93 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,93 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 0,88 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 07.04.2021 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,90 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,67% |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation I Hedged (i) (HUF) | 30.09.2021 | 0,69% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 0,68% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,75% |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,26% |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 1,28% |
| Capitalisation P Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 1,27% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 1,76% |
| Capitalisation X Hedged (i) (RON) | 30.09.2021 | 1,78% |
| Capitalisation X Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 1,76% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,17% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 0,02% |
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,26% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,75% |
| Distribution R Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 0,77% |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | 1,76% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1,78% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 1,78% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 2,77% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 2,78% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 311,35% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **794.192.720,30** |
| Aktien | | 274.463.363,49 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 25.140.593,77 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | 3.789.204,40 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 490.799.558,64 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **6.796.221,03** |
| Futures | | 6.781.056,60 |
| Optionsscheine und Bezugsrechte | | 15.164,43 |
| **Bankguthaben** | | **15.936.158,55** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **5.725.004,47** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **15.529.829,19** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***838.179.933,54*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(7.602.410,13)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(5.990.880,43)** |
| Credit Default Swaps | | (1.907.907,18) |
| Devisentermingeschäfte | | (4.082.973,25) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(13.593.290,56)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***824.586.642,98*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **12.841.217,62** |
| Dividenden | | 5.235.506,24 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 7.587.275,94 |
| Sonstige Erträge | 10 | 18.435,44 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(5.430.225,64)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (3.496.914,50) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.016.643,76) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (23.493,02) |
| Abonnementsteuer | 9 | (112.492,52) |
| Bankzinsen | | (181.599,62) |
| Zinsen auf Swaps | | (599.082,22) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **7.410.991,98** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 90.978.199,54 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (46.207.922,49) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 54.110.578,22 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (74.980.198,35) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 9.278.602,13 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (8.958.238,63) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 13.709.945,10 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 7.418.158,81 |
| **Ergebnis** | | **52.760.116,31** |
| Zeichnungen | | 81.806.696,79 |
| Rücknahmen | | (156.738.033,42) |
| Ausschüttung | | (1.414.940,01) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 848.172.803,31 |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***824.586.642,98*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

**Vereinigte Staaten**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 5.262 | ABBVIE INC | USD | 489.763,96 | 0,06 |
| 2.409 | ADOBE INC | USD | 1.196.694,84 | 0,15 |
| 6.202 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | USD | 550.658,61 | 0,07 |
| 1.693 | AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC | USD | 374.126,78 | 0,05 |
| 4.385 | ALPHABET INC - C | USD | 10.084.459,51 | 1,22 |
| 2.341 | AMAZON.COM INC | USD | 6.635.556,87 | 0,80 |
| 3.601 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 820.653,28 | 0,10 |
| 2.728 | AMGEN INC | USD | 500.547,22 | 0,06 |
| 83.376 | APPLE INC | USD | 10.179.648,82 | 1,22 |
| 6.130 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 680.887,79 | 0,08 |
| 2.963 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 566.650,26 | 0,07 |
| 33.063 | BAKER HUGHES CO - A | USD | 705.507,56 | 0,09 |
| 48.548 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 1.778.215,28 | 0,21 |
| 259 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 530.508,07 | 0,06 |
| 6.634 | BROWN & BROWN INC | USD | 317.403,94 | 0,04 |
| 1.759 | BURLINGTON STORES INC | USD | 430.389,26 | 0,05 |
| 1.544 | CARMAX INC | USD | 170.473,48 | 0,02 |
| 4.301 | CATALENT INC | USD | 493.838,45 | 0,06 |
| 9.522 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 1.017.640,90 | 0,12 |
| 5.936 | CBRE GROUP INC - A | USD | 498.666,00 | 0,06 |
| 11.153 | CHENIERE ENERGY INC | USD | 939.914,16 | 0,11 |
| 16.422 | CHEVRON CORP | USD | 1.437.518,36 | 0,17 |
| 4.124 | CIGNA CORP | USD | 712.248,02 | 0,09 |
| 2.479 | CINTAS CORP | USD | 814.233,69 | 0,10 |
| 22.805 | CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE | USD | 1.071.035,12 | 0,13 |
| 5.071 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 330.701,22 | 0,04 |
| 31.192 | COMCAST CORP - A | USD | 1.505.300,97 | 0,18 |
| 5.912 | COPART INC | USD | 707.634,19 | 0,09 |
| 2.806 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 1.087.946,93 | 0,13 |
| 811 | CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | USD | 171.989,80 | 0,02 |
| 4.243 | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | USD | 634.537,09 | 0,08 |
| 23.912 | CSX CORP | USD | 613.609,63 | 0,07 |
| 3.845 | CUMMINS INC | USD | 745.013,33 | 0,09 |
| 3.068 | DANAHER CORP | USD | 805.920,81 | 0,10 |
| 1.520 | DEERE & CO | USD | 439.455,02 | 0,05 |
| 3.060 | DELL TECHNOLOGIES INC - C | USD | 274.698,99 | 0,03 |
| 950 | DOMINO'S PIZZA INC | USD | 390.967,69 | 0,05 |
| 9.789 | DOVER CORP | USD | 1.313.421,20 | 0,16 |
| 10.715 | EBAY INC | USD | 644.129,64 | 0,08 |
| 4.012 | ECOLAB INC | USD | 722.191,16 | 0,09 |
| 6.232 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 608.762,00 | 0,07 |
| 5.472 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 671.635,53 | 0,08 |
| 3.295 | ELI LILLY & CO | USD | 656.896,11 | 0,08 |
| 14.337 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 1.165.318,09 | 0,14 |
| 1.460 | EPAM SYSTEMS INC | USD | 718.668,45 | 0,09 |
| 2.762 | ESTEE LAUDER COS INC/THE - A | USD | 714.790,68 | 0,09 |
| 12.974 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 915.271,79 | 0,11 |
| 30.779 | FIFTH THIRD BANCORP | USD | 1.127.107,09 | 0,14 |
| 22.549 | FORD MOTOR CO | USD | 275.502,69 | 0,03 |
| 10.592 | FORTIVE CORP | USD | 644.960,90 | 0,08 |
| 3.000 | GARTNER INC | USD | 786.608,57 | 0,10 |
| 12.965 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 781.401,48 | 0,09 |
| 4.585 | HCA HEALTHCARE INC | USD | 960.240,91 | 0,12 |
| 6.095 | HERSHEY CO/THE | USD | 890.097,72 | 0,11 |
| 5.227 | HOME DEPOT INC/THE | USD | 1.480.490,98 | 0,18 |
| 13.385 | HP INC | USD | 315.987,40 | 0,04 |
| 1.193 | IDEXX LABORATORIES INC | USD | 640.171,45 | 0,08 |
| 959 | ILLUMINA INC | USD | 335.631,38 | 0,04 |
| 3.841 | INCYTE CORP | USD | 227.951,15 | 0,03 |
| 9.995 | INGERSOLL-RAND PLC | USD | 434.745,20 | 0,05 |
| 9.500 | INTEL CORP | USD | 436.740,15 | 0,05 |
| 1.943 | INTUIT INC | USD | 904.497,98 | 0,11 |
| 1.867 | INTUITIVE SURGICAL INC | USD | 1.601.516,93 | 0,19 |
| 1.159 | IQVIA HOLDINGS INC | USD | 239.550,33 | 0,03 |
| 16.931 | IRON MOUNTAIN INC | USD | 634.757,28 | 0,08 |
| 29.727 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 4.198.638,97 | 0,51 |
| 1.583 | KANSAS CITY SOUTHERN | USD | 369.664,89 | 0,04 |
| 11.300 | KEURIG DR PEPPER INC | USD | 333.067,00 | 0,04 |
| 14.876 | KROGER CO/THE | USD | 518.949,64 | 0,06 |
| 808 | LAM RESEARCH CORP | USD | 396.801,59 | 0,05 |
| 4.922 | LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | USD | 387.024,34 | 0,05 |
| 2.535 | LULULEMON ATHLETICA INC | USD | 885.210,32 | 0,11 |
| 2.719 | MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A | USD | 347.432,34 | 0,04 |
| 6.450 | MCDONALD'S CORP | USD | 1.341.869,36 | 0,16 |
| 384 | MERCADOLIBRE INC | USD | 556.442,99 | 0,07 |
| 15.053 | MERCK & CO INC | USD | 975.564,80 | 0,12 |
| 11.114 | METLIFE INC | USD | 591.973,10 | 0,07 |
| 45.031 | MICROSOFT CORP | USD | 10.954.001,05 | 1,33 |
| 2.330 | MOLINA HEALTHCARE INC | USD | 545.452,61 | 0,07 |
| 15.979 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A | USD | 802.155,59 | 0,10 |
| 5.066 | MONSTER BEVERAGE CORP | USD | 388.293,52 | 0,05 |
| 2.639 | MOODY'S CORP | USD | 808.607,18 | 0,10 |
| 30.835 | MORGAN STANLEY | USD | 2.589.027,87 | 0,31 |
| 6.900 | NASDAQ INC | USD | 1.149.176,41 | 0,14 |
| 9.589 | NETAPP INC | USD | 742.662,44 | 0,09 |
| 6.789 | NIKE INC - B | USD | 850.741,16 | 0,10 |
| 2.771 | NORFOLK SOUTHERN CORP | USD | 572.036,54 | 0,07 |
| 12.107 | NVIDIA CORP | USD | 2.164.102,09 | 0,26 |
| 13.197 | ONEOK INC | USD | 660.333,95 | 0,08 |
| 2.215 | ORACLE CORP | USD | 166.523,97 | 0,02 |
| 4.905 | PACKAGING CORP OF AMERICA | USD | 581.684,46 | 0,07 |
| 7.847 | PAYCHEX INC | USD | 761.374,65 | 0,09 |
| 7.077 | PAYPAL HOLDINGS INC | USD | 1.588.943,59 | 0,19 |
| 13.270 | PEPSICO INC | USD | 1.722.197,42 | 0,21 |
| 2.744 | PERKINELMER INC | USD | 410.291,87 | 0,05 |
| 26.737 | PFIZER INC | USD | 992.241,57 | 0,12 |
| 6.145 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 1.037.324,99 | 0,13 |
| 20.011 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | USD | 2.413.855,47 | 0,29 |
| 6.991 | PROLOGIS INC | USD | 756.616,88 | 0,09 |
| 7.778 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | USD | 706.023,21 | 0,09 |
| 802 | PTC INC | USD | 82.895,36 | 0,01 |
| 5.501 | PULTEGROUP INC | USD | 217.961,02 | 0,03 |
| 1.566 | REGENERON PHARMACEUTICALS INC | USD | 817.733,19 | 0,10 |
| 2.394 | RESMED INC | USD | 544.405,45 | 0,07 |
| 8.791 | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | USD | 761.034,58 | 0,09 |
| 904 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 229.356,02 | 0,03 |
| 609 | ROPER TECHNOLOGIES INC | USD | 234.430,45 | 0,03 |
| 5.917 | SALESFORCE.COM INC | USD | 1.384.709,21 | 0,17 |
| 2.682 | SERVICENOW INC | USD | 1.440.034,63 | 0,17 |
| 1.955 | SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | USD | 471.868,63 | 0,06 |
| 10.509 | SNAP INC - A | USD | 669.830,30 | 0,08 |
| 825 | SNAP-ON INC | USD | 148.741,32 | 0,02 |
| 12.903 | SOUTHWEST AIRLINES CO | USD | 572.588,37 | 0,07 |
| 2.669 | S&P GLOBAL INC | USD | 978.498,99 | 0,12 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 799 | SQUARE INC - A | USD | 165.349,81 | 0,02 |
| 3.097 | STANLEY BLACK & DECKER INC | USD | 468.471,52 | 0,06 |
| 6.478 | STARBUCKS CORP | USD | 616.582,41 | 0,07 |
| 8.565 | SYSCO CORP | USD | 580.139,35 | 0,07 |
| 5.196 | TARGET CORP | USD | 1.025.660,23 | 0,12 |
| 2.503 | TERADYNE INC | USD | 235.775,93 | 0,03 |
| 3.092 | TESLA INC | USD | 2.068.928,05 | 0,25 |
| 8.908 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 1.477.377,52 | 0,18 |
| 3.541 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 1.745.614,16 | 0,21 |
| 12.775 | TJX COS INC/THE | USD | 727.291,51 | 0,09 |
| 6.594 | T-MOBILE US INC | USD | 726.907,49 | 0,09 |
| 8.009 | TWITTER INC | USD | 417.329,06 | 0,05 |
| 404 | TYLER TECHNOLOGIES INC/THE | USD | 159.881,44 | 0,02 |
| 22.470 | UGI CORP | USD | 826.326,76 | 0,10 |
| 6.395 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 2.156.074,29 | 0,26 |
| 3.691 | UNITY SOFTWARE INC | USD | 402.078,39 | 0,05 |
| 31.338 | US BANCORP | USD | 1.607.257,19 | 0,19 |
| 18.826 | VENTAS INC | USD | 896.832,01 | 0,11 |
| 31.886 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 1.485.968,21 | 0,18 |
| 17.891 | VIACOMCBS INC - B | USD | 609.925,72 | 0,07 |
| 9.842 | VISA INC - A | USD | 1.891.630,79 | 0,23 |
| 2.367 | VORNADO REALTY TRUST | USD | 85.799,79 | 0,01 |
| 4.599 | VOYA FINANCIAL INC | USD | 243.610,69 | 0,03 |
| 9.555 | WALT DISNEY CO/THE | USD | 1.394.727,43 | 0,17 |
| 4.485 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 578.005,61 | 0,07 |
| 5.450 | WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP | USD | 405.405,32 | 0,05 |
| 5.571 | WEYERHAEUSER CO | USD | 170.982,76 | 0,02 |
| 2.781 | WHIRLPOOL CORP | USD | 489.179,57 | 0,06 |
| 4.251 | XILINX INC | USD | 553.827,59 | 0,07 |
| 7.394 | XYLEM INC/NY | USD | 789.067,62 | 0,10 |
| 1.715 | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A | USD | 762.712,20 | 0,09 |
| 5.216 | ZOETIS INC - A | USD | 873.751,45 | 0,11 |
| 2.537 | 3M CO | USD | 384.003,23 | 0,05 |
| | | | **151.396.930,59** | **18,36** |
| | **Japan** | | | |
| 16.900 | AEON MALL CO LTD | JPY | 224.775,71 | 0,03 |
| 7.400 | AISIN CORP | JPY | 232.220,05 | 0,03 |
| 21.300 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD | JPY | 890.292,23 | 0,11 |
| 51.445 | ASTELLAS PHARMA INC | JPY | 730.843,25 | 0,09 |
| 105.300 | CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD | JPY | 358.859,31 | 0,04 |
| 6.800 | DENSO CORP | JPY | 385.100,68 | 0,05 |
| 4.800 | EISAI CO LTD | JPY | 310.732,91 | 0,04 |
| 500 | FAST RETAILING CO LTD | JPY | 317.974,46 | 0,04 |
| 14.000 | HITACHI LTD | JPY | 716.753,28 | 0,09 |
| 25.940 | ITOCHU CORP | JPY | 655.420,45 | 0,08 |
| 19.600 | KAJIMA CORP | JPY | 217.918,90 | 0,03 |
| 9.400 | KDDI CORP | JPY | 267.513,36 | 0,03 |
| 93.000 | MARUBENI CORP | JPY | 669.161,97 | 0,08 |
| 2.800 | MEIJI HOLDINGS CO LTD | JPY | 155.656,36 | 0,02 |
| 22.100 | MINEBEA MITSUMI INC | JPY | 488.021,40 | 0,06 |
| 50.900 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS CORP | JPY | 401.679,07 | 0,05 |
| 178.900 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC | JPY | 907.494,08 | 0,11 |
| 18.000 | MITSUI CHEMICALS INC | JPY | 522.529,80 | 0,06 |
| 2.900 | NIPPON YUSEN KK | JPY | 188.941,90 | 0,02 |
| 26.600 | NOMURA RESEARCH INSTITUTE LTD | JPY | 849.093,57 | 0,10 |
| 8.600 | OMRON CORP | JPY | 736.029,14 | 0,09 |
| 169 | ORIX JREIT INC | JPY | 252.791,23 | 0,03 |
| 49.700 | PANASONIC CORP | JPY | 532.653,47 | 0,06 |
| 25.200 | SEKISUI CHEMICAL CO LTD | JPY | 374.417,24 | 0,05 |
| 5.000 | SHISEIDO CO LTD | JPY | 290.564,19 | 0,04 |
| 53.600 | SOFTBANK CORP | JPY | 625.903,88 | 0,08 |
| 19.600 | SOMPO HOLDINGS INC | JPY | 737.629,80 | 0,09 |
| 5.900 | SONY GROUP CORP | JPY | 566.590,54 | 0,07 |
| 23.200 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 661.676,77 | 0,08 |
| 2.557 | TOKYO ELECTRON LTD | JPY | 979.261,01 | 0,12 |
| 10.900 | TOYODA GOSEI CO LTD | JPY | 188.843,98 | 0,02 |
| 16.800 | TOYOTA TSUSHO CORP | JPY | 615.932,86 | 0,07 |
| 5.300 | YAMAHA CORP | JPY | 288.096,88 | 0,03 |
| 11.600 | YAMAHA MOTOR CO LTD | JPY | 279.052,65 | 0,03 |
| | | | **16.620.426,38** | **2,02** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 9.735 | ASHTEAD GROUP PLC | GBP | 639.462,00 | 0,08 |
| 10.284 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 1.071.793,31 | 0,13 |
| 123.315 | AVIVA PLC | GBP | 567.988,22 | 0,07 |
| 326.214 | BP PLC | GBP | 1.291.523,93 | 0,16 |
| 8.651 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | USD | 412.713,05 | 0,05 |
| 23.236 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 411.987,70 | 0,05 |
| 23.761 | DIAGEO PLC | GBP | 996.846,64 | 0,12 |
| 12.123 | HALMA PLC | GBP | 400.840,96 | 0,05 |
| 646.664 | LLOYDS BANKING GROUP PLC | GBP | 350.366,71 | 0,04 |
| 4.583 | NEXT PLC | GBP | 437.861,45 | 0,05 |
| 40.736 | RENTOKIL INITIAL PLC | GBP | 276.586,89 | 0,03 |
| 16.832 | SEGRO PLC | GBP | 234.013,84 | 0,03 |
| 10.085 | SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | USD | 476.164,80 | 0,06 |
| 10.412 | SMITH & NEPHEW PLC | GBP | 155.901,62 | 0,02 |
| 1.285 | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | GBP | 223.801,42 | 0,03 |
| 203.317 | TESCO PLC | GBP | 599.165,50 | 0,07 |
| 10.405 | UNILEVER PLC | GBP | 484.822,22 | 0,06 |
| 20.220 | UNITED UTILITIES GROUP PLC | GBP | 227.810,56 | 0,03 |
| 34.370 | 3I GROUP PLC | GBP | 512.431,78 | 0,06 |
| | | | **9.772.082,60** | **1,19** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 66.800 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | HKD | 1.049.729,60 | 0,13 |
| 1.705 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR | USD | 217.805,13 | 0,03 |
| 18.000 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | HKD | 292.011,49 | 0,04 |
| 56.000 | CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD | HKD | 241.972,59 | 0,03 |
| 64.000 | CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD | HKD | 354.692,73 | 0,04 |
| 94.500 | CK ASSET HOLDINGS LTD | HKD | 470.987,88 | 0,06 |
| 22.000 | COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD | HKD | 149.519,96 | 0,02 |
| 10.900 | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | HKD | 154.665,31 | 0,02 |
| 28.500 | JD.COM INC - A | HKD | 891.947,91 | 0,11 |
| 43.500 | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 172.577,87 | 0,02 |
| 18.487 | MEITUAN - B | HKD | 503.803,17 | 0,06 |
| 36.228 | NETEASE INC | HKD | 526.467,42 | 0,06 |
| 4.000 | SILERGY CORP | TWD | 507.019,57 | 0,06 |
| 14.400 | SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | HKD | 325.907,10 | 0,04 |
| 34.600 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 1.764.229,47 | 0,21 |
| 104.000 | TINGYI CAYMAN ISLANDS HOLDING CORP | HKD | 166.419,14 | 0,01 |
| 76.500 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | HKD | 1.069.432,42 | 0,13 |
| | | | **8.859.188,76** | **1,07** |
| | **Schweiz** | | | |
| 222 | EMS-CHEMIE HOLDING AG - REG | CHF | 181.521,77 | 0,02 |
| 4.174 | GARMIN LTD | USD | 559.894,77 | 0,07 |
| 873 | GEBERIT AG - REG | CHF | 556.361,34 | 0,07 |
| 41 | GIVAUDAN SA - REG | CHF | 161.629,56 | 0,02 |
| 19.441 | NESTLE SA - REG | CHF | 2.026.590,45 | 0,25 |
| 682 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 925.102,63 | 0,11 |
| 2.201 | ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN | CHF | 696.155,29 | 0,08 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.340 | SIKA AG - REG | CHF | 642.396,59 | 0,08 |
| 2.271 | SONOVA HOLDING AG - REG | CHF | 746.128,39 | 0,09 |
| 4.734 | SWISS PRIME SITE AG - REG | CHF | 400.219,20 | 0,05 |
| 1.143 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 568.155,70 | 0,07 |
| 4.570 | TE CONNECTIVITY LTD | USD | 541.089,26 | 0,07 |
| 53.533 | UBS GROUP AG - REG | CHF | 742.739,15 | 0,08 |
| | | | **8.747.984,10** | **1,06** |
| | **Kanada** | | | |
| 20.698 | BANK OF NOVA SCOTIA/THE | CAD | 1.099.031,93 | 0,13 |
| 13.829 | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | CAD | 1.328.067,00 | 0,16 |
| 8.070 | CCL INDUSTRIES INC - B | CAD | 360.568,24 | 0,04 |
| 17.145 | GILDAN ACTIVEWEAR INC - A | CAD | 540.431,85 | 0,07 |
| 39.476 | HYDRO ONE LTD | CAD | 804.998,43 | 0,10 |
| 10.776 | IGM FINANCIAL INC | CAD | 332.113,30 | 0,04 |
| 19.266 | KEYERA CORP | CAD | 418.199,70 | 0,05 |
| 12.969 | LUNDIN MINING CORP | CAD | 80.470,18 | 0,01 |
| 9.428 | MANULIFE FINANCIAL CORP | CAD | 156.553,71 | 0,02 |
| 4.060 | METRO INC | CAD | 171.142,00 | 0,02 |
| 792 | SHOPIFY INC - A | CAD | 927.399,24 | 0,11 |
| 27.369 | SUN LIFE FINANCIAL INC | CAD | 1.215.392,70 | 0,15 |
| 31.352 | TELUS CORP | CAD | 594.490,03 | 0,07 |
| 4.891 | THOMSON REUTERS CORP | CAD | 466.542,14 | 0,06 |
| 1.786 | TMX GROUP LTD | CAD | 166.153,87 | 0,02 |
| | | | **8.661.554,32** | **1,05** |
| | **Frankreich** | | | |
| 14.500 | AXA SA | EUR | 349.232,50 | 0,04 |
| 4.344 | CAPGEMINI SE | EUR | 782.571,60 | 0,09 |
| 3.771 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA | EUR | 500.788,80 | 0,06 |
| 11.359 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 661.548,16 | 0,08 |
| 27.281 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 325.898,83 | 0,04 |
| 1.694 | EDENRED | EUR | 78.991,22 | 0,01 |
| 534 | HERMES INTERNATIONAL | EUR | 638.931,00 | 0,08 |
| 6.478 | LEGRAND SA | EUR | 600.899,28 | 0,07 |
| 3.182 | L'OREAL SA | EUR | 1.135.496,70 | 0,14 |
| 2.637 | PERNOD RICARD SA | EUR | 502.875,90 | 0,06 |
| 1.579 | TELEPERFORMANCE | EUR | 537.017,90 | 0,07 |
| 37.363 | TOTALENERGIES SE | EUR | 1.544.399,61 | 0,18 |
| 14.303 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA | EUR | 378.457,38 | 0,05 |
| 19.761 | VIVENDI SE | EUR | 215.493,71 | 0,03 |
| | | | **8.252.602,59** | **1,00** |
| | **Irland** | | | |
| 5.743 | ACCENTURE PLC - A | USD | 1.585.314,78 | 0,19 |
| 2.529 | AON PLC - A | USD | 623.592,33 | 0,08 |
| 11.365 | CRH PLC | EUR | 460.964,40 | 0,06 |
| 2.717 | HORIZON THERAPEUTICS PLC | USD | 256.801,57 | 0,03 |
| 3.678 | LINDE PLC | USD | 931.059,70 | 0,11 |
| 17.542 | MEDTRONIC PLC | USD | 1.897.311,96 | 0,22 |
| 8.766 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 397.801,08 | 0,05 |
| 4.562 | STERIS PLC | USD | 804.111,79 | 0,10 |
| | | | **6.956.957,61** | **0,84** |
| | **Deutschland** | | | |
| 1.984 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 386.562,56 | 0,05 |
| 24.631 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 1.341.896,88 | 0,16 |
| 19.903 | EVONIK INDUSTRIES AG | EUR | 542.754,81 | 0,07 |
| 2.632 | MERCK KGAA | EUR | 493.894,80 | 0,06 |
| 1.038 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 245.902,20 | 0,03 |
| 4.889 | NEMETSCHEK SE | EUR | 443.432,30 | 0,05 |
| 8.225 | SIEMENS AG - REG | EUR | 1.167.292,00 | 0,14 |
| 10.906 | SIEMENS HEALTHINEERS AG | EUR | 612.699,08 | 0,07 |
| 65.086 | TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | EUR | 159.981,39 | 0,03 |
| 6.135 | VONOVIA SE | EUR | 318.406,50 | 0,04 |
| 3.617 | ZALANDO SE | EUR | 286.900,44 | 0,03 |
| | | | **5.999.722,96** | **0,73** |
| | **Taiwan** | | | |
| 9.000 | ACCTON TECHNOLOGY CORP | TWD | 73.088,63 | 0,01 |
| 19.455 | ADVANTECH CO LTD | TWD | 219.268,21 | 0,03 |
| 487.012 | CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 344.371,11 | 0,03 |
| 30.000 | DELTA ELECTRONICS INC | TWD | 233.438,97 | 0,03 |
| 13.000 | ECLAT TEXTILE CO LTD | TWD | 243.659,65 | 0,03 |
| 32.000 | MEDIATEK INC | TWD | 894.231,83 | 0,11 |
| 167.922 | MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 166.183,23 | 0,02 |
| 111.000 | TAIWAN MOBILE CO LTD | TWD | 338.977,47 | 0,04 |
| 138.922 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 2.488.001,21 | 0,30 |
| 203.160 | UNITED MICROELECTRONICS CORP | TWD | 401.485,39 | 0,05 |
| 8.000 | WIWYNN CORP | TWD | 214.912,07 | 0,03 |
| | | | **5.617.617,77** | **0,68** |
| | **Niederlande** | | | |
| 315 | ADYEN NV | EUR | 760.725,00 | 0,09 |
| 1.583 | AKZO NOBEL NV | EUR | 149.403,54 | 0,02 |
| 2.196 | ASML HOLDING NV | EUR | 1.418.396,40 | 0,17 |
| 3.541 | KONINKLIJKE PHILIPS NV | EUR | 135.761,94 | 0,02 |
| 8.055 | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A | USD | 652.281,59 | 0,08 |
| 5.547 | PROSUS NV | EUR | 382.687,53 | 0,05 |
| 47.461 | STELLANTIS NV | EUR | 786.713,54 | 0,09 |
| 19.761 | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | EUR | 456.775,52 | 0,06 |
| 6.538 | WOLTERS KLUWER NV | EUR | 598.750,04 | 0,07 |
| | | | **5.341.495,10** | **0,65** |
| | **Australien** | | | |
| 22.700 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD | AUD | 397.093,13 | 0,05 |
| 24.601 | BRAMBLES LTD | AUD | 164.648,05 | 0,02 |
| 2.236 | COCHLEAR LTD | AUD | 306.246,77 | 0,04 |
| 40.036 | COMPUTERSHARE LTD | AUD | 453.301,52 | 0,04 |
| 3.273 | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD | AUD | 326.363,00 | 0,04 |
| 16.746 | FORTESCUE METALS GROUP LTD | AUD | 155.679,28 | 0,02 |
| 29.601 | GOODMAN GROUP | AUD | 398.798,75 | 0,05 |
| 5.224 | MACQUARIE GROUP LTD | AUD | 590.830,19 | 0,07 |
| 4.930 | REA GROUP LTD | AUD | 486.656,20 | 0,06 |
| 18.085 | SONIC HEALTHCARE LTD | AUD | 456.955,60 | 0,06 |
| 16.340 | WESFARMERS LTD | AUD | 566.089,43 | 0,07 |
| 10.099 | WOOLWORTHS GROUP LTD | AUD | 246.951,25 | 0,03 |
| | | | **4.549.613,17** | **0,55** |
| | **Südkorea** | | | |
| 774 | CJ CHEILJEDANG CORP | KRW | 230.294,51 | 0,03 |
| 11.941 | HANA FINANCIAL GROUP INC | KRW | 402.575,56 | 0,05 |
| 4.186 | HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | KRW | 156.333,15 | 0,02 |
| 8.390 | HYUNDAI STEEL CO | KRW | 288.649,41 | 0,04 |
| 300 | LG CHEM LTD | KRW | 169.149,88 | 0,02 |
| 1.507 | NAVER CORP | KRW | 424.848,12 | 0,05 |
| 15.266 | SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | KRW | 283.403,29 | 0,03 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.422 | SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD | KRW | 242.804,20 | 0,03 |
| 661 | SAMSUNG SDS CO LTD | KRW | 77.084,17 | 0,01 |
| 15.055 | SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | KRW | 441.927,32 | 0,05 |
| 2.929 | SK HYNIX INC | KRW | 219.202,41 | 0,03 |
| 1.856 | SK INNOVATION CO LTD | KRW | 357.365,46 | 0,04 |
| 1.866 | SK TELECOM CO LTD | KRW | 439.283,99 | 0,05 |
| | | | **3.732.921,47** | **0,45** |
| | **Bermuda** | | | |
| 9.417 | ATHENE HOLDING LTD - A | USD | 559.600,32 | 0,07 |
| 22.426 | AXALTA COATING SYSTEMS LTD | USD | 564.834,50 | 0,07 |
| 544.000 | BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE HOLDINGS LTD | HKD | 438.857,12 | 0,05 |
| 32.000 | CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | HKD | 144.635,42 | 0,02 |
| 11.387 | IHS MARKIT LTD | USD | 1.145.823,32 | 0,14 |
| | | | **2.853.750,68** | **0,35** |
| | **China** | | | |
| 2.220.100 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD -H | HKD | 657.519,71 | 0,08 |
| 348.000 | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD - H | HKD | 226.514,44 | 0,03 |
| 673.000 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP - H | HKD | 415.002,41 | 0,05 |
| 14.000 | GANFENG LITHIUM CO LTD - H | HKD | 214.124,08 | 0,03 |
| 599.000 | PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP - H | HKD | 160.193,04 | 0,02 |
| 416.000 | PICC PROPERTY & CASUALTY CO LTD - H | HKD | 347.089,67 | 0,04 |
| 374.000 | ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD - H | HKD | 265.343,25 | 0,03 |
| | | | **2.285.786,60** | **0,28** |
| | **Österreich** | | | |
| 12.395 | OMV AG | EUR | 646.771,10 | 0,07 |
| 11.640 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | EUR | 263.995,20 | 0,03 |
| 10.528 | VERBUND AG | EUR | 923.305,60 | 0,11 |
| 7.207 | VOESTALPINE AG | EUR | 230.912,28 | 0,03 |
| | | | **2.064.984,18** | **0,24** |
| | **Italien** | | | |
| 14.812 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA | EUR | 272.392,68 | 0,03 |
| 27.694 | FINECOBANK BANCA FINECO SPA | EUR | 433.964,98 | 0,05 |
| 8.135 | RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA SPA | EUR | 409.027,80 | 0,05 |
| 85.603 | SNAM SPA | EUR | 410.551,99 | 0,05 |
| 26.193 | UNICREDIT SPA | EUR | 301.219,50 | 0,04 |
| | | | **1.827.156,95** | **0,22** |
| | **Hongkong** | | | |
| 14.200 | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | HKD | 752.921,97 | 0,09 |
| 364.000 | PCCW LTD | HKD | 160.902,49 | 0,02 |
| 38.500 | SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD | HKD | 414.401,26 | 0,05 |
| 22.000 | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | HKD | 377.082,05 | 0,05 |
| | | | **1.705.307,77** | **0,21** |
| | **Schweden** | | | |
| 14.908 | ATLAS COPCO AB - A | SEK | 782.516,43 | 0,09 |
| 2.780 | BOLIDEN AB | SEK | 77.402,48 | 0,01 |
| 61.451 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB - A | SEK | 750.930,03 | 0,10 |
| 5.978 | SVENSKA CELLULOSA AB SCA -B | SEK | 80.421,00 | 0,01 |
| | | | **1.691.269,94** | **0,21** |
| | **Spanien** | | | |
| 1.195 | AENA SME SA | EUR | 178.413,50 | 0,02 |
| 2.784 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 158.353,92 | 0,02 |
| 22.301 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 709.617,82 | 0,09 |
| 29.510 | NATURGY ENERGY GROUP SA | EUR | 641.842,50 | 0,07 |
| | | | **1.688.227,74** | **0,20** |
| | **Russland** | | | |
| 158.040 | ALROSA PJSC | RUB | 249.216,83 | 0,03 |
| 17.591 | MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR | USD | 146.319,72 | 0,02 |
| 237.900 | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC | RUB | 490.526,34 | 0,05 |
| 195.637 | SBERBANK OF RUSSIA PJSC | RUB | 790.394,62 | 0,10 |
| | | | **1.676.457,51** | **0,20** |
| | **Dänemark** | | | |
| 19.638 | NOVO NORDISK AS - B | DKK | 1.641.091,03 | 0,20 |
| | | | **1.641.091,03** | **0,20** |
| | **Südafrika** | | | |
| 13.798 | BID CORP LTD | ZAR | 255.291,91 | 0,03 |
| 29.555 | BIDVEST GROUP LTD/THE | ZAR | 332.223,33 | 0,04 |
| 11.128 | CLICKS GROUP LTD | ZAR | 177.229,53 | 0,02 |
| 6.066 | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | ZAR | 59.722,76 | 0,01 |
| 22.600 | STANDARD BANK GROUP LTD | ZAR | 185.581,16 | 0,02 |
| 32.557 | VODACOM GROUP LTD | ZAR | 268.949,40 | 0,04 |
| | | | **1.278.998,09** | **0,16** |
| | **Brasilien** | | | |
| 39.034 | BANCO SANTANDER BRASIL SA | BRL | 218.627,39 | 0,03 |
| 55.559 | CPFL ENERGIA SA | BRL | 236.928,46 | 0,02 |
| 30.793 | HYPERA SA | BRL | 156.719,97 | 0,02 |
| 37.377 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA - PREF | BRL | 171.229,79 | 0,02 |
| 16.363 | LOCALIZA RENT A CAR SA | BRL | 141.138,91 | 0,02 |
| 49.906 | RUMO SA | BRL | 132.687,47 | 0,02 |
| | | | **1.057.331,99** | **0,13** |
| | **Mexiko** | | | |
| 46.379 | FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV | MXN | 348.805,99 | 0,04 |
| 61.061 | GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV | MXN | 339.258,43 | 0,04 |
| 112.895 | WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | MXN | 331.666,91 | 0,04 |
| | | | **1.019.731,33** | **0,12** |
| | **Jersey** | | | |
| 4.282 | APTIV PLC | USD | 550.402,99 | 0,07 |
| 37.654 | WPP PLC | GBP | 438.294,61 | 0,05 |
| | | | **988.697,60** | **0,12** |
| | **Singapur** | | | |
| 56.600 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD | SGD | 412.461,03 | 0,05 |
| 34.600 | UNITED OVERSEAS BANK LTD | SGD | 566.767,96 | 0,07 |
| | | | **979.228,99** | **0,12** |
| | **Norwegen** | | | |
| 150.216 | NORSK HYDRO ASA | NOK | 972.855,71 | 0,12 |
| | | | **972.855,71** | **0,12** |
| | **Curacao** | | | |
| 30.223 | SCHLUMBERGER NV | USD | 772.949,41 | 0,09 |
| | | | **772.949,41** | **0,09** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 81.313 | MERIDIAN ENERGY LTD | NZD | 237.904,07 | 0,03 |
| 154.948 | SPARK NEW ZEALAND LTD | NZD | 439.550,61 | 0,05 |
| | | | **677.454,68** | **0,08** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Belgien** | | | |
| 1.987 | AGEAS SA/NV | EUR | 85.083,34 | 0,01 |
| 7.362 | KBC GROUP NV | EUR | 574.530,48 | 0,07 |
| | | | **659.613,82** | **0,08** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 2.407 | GLOBANT SA | USD | 583.624,03 | 0,07 |
| | | | **583.624,03** | **0,07** |
| | **Israel** | | | |
| 49.992 | BANK HAPOALIM BM | ILS | 381.062,40 | 0,05 |
| 1.169 | WIX.COM LTD | USD | 197.669,38 | 0,02 |
| | | | **578.731,78** | **0,07** |
| | **Indonesien** | | | |
| 134.000 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | IDR | 281.901,77 | 0,03 |
| 1.241.300 | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT | IDR | 275.313,87 | 0,04 |
| | | | **557.215,64** | **0,07** |
| | **Thailand** | | | |
| 152.900 | ENERGY ABSOLUTE PCL | THB | 238.115,61 | 0,03 |
| 379.000 | MINOR INTERNATIONAL PCL | THB | 303.545,68 | 0,04 |
| | | | **541.661,29** | **0,07** |
| | **Finnland** | | | |
| 9.899 | NESTE OYJ | EUR | 484.754,03 | 0,06 |
| | | | **484.754,03** | **0,06** |
| | **Malaysia** | | | |
| 3.700 | NESTLE MALAYSIA BHD | MYR | 101.197,35 | 0,01 |
| 392.400 | PUBLIC BANK BHD | MYR | 328.180,53 | 0,04 |
| | | | **429.377,88** | **0,05** |
| | **Philippinen** | | | |
| 127.530 | INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SERVICES INC | PHP | 419.403,56 | 0,05 |
| | | | **419.403,56** | **0,05** |
| | **Chile** | | | |
| 1.954.683 | BANCO SANTANDER CHILE | CLP | 84.371,44 | 0,01 |
| 23.971 | EMPRESAS COPEC SA | CLP | 171.385,27 | 0,02 |
| | | | **255.756,71** | **0,03** |
| | **Ungarn** | | | |
| 2.836 | OTP BANK NYRT | HUF | 143.688,88 | 0,02 |
| | | | **143.688,88** | **0,02** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 34.219 | MONETA MONEY BANK AS | CZK | 119.158,25 | 0,01 |
| | | | **119.158,25** | **0,01** |
| | | | **274.463.363,49** | **33,28** |

### Anleihen und andere Schuldtitel

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 351.000 | AETHON UNITED BR LP / AETHON UNITED FINANCE CORP 8.250% 15/02/2026 | USD | 327.071,90 | 0,04 |
| 800.000 | ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 4.875% 15/02/2030 | USD | 745.456,09 | 0,09 |
| 1.289.000 | AMERICAN AIRLINES INC 11.750% 15/07/2025 | USD | 1.375.859,97 | 0,17 |
| 750.000 | AMSTED INDUSTRIES INC 4.625% 15/05/2030 | USD | 669.600,98 | 0,08 |
| 650.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 01/03/2027 | USD | 579.680,00 | 0,07 |
| 422.000 | ANTERO RESOURCES CORP 7.625% 01/02/2029 | USD | 406.893,62 | 0,05 |
| 500.000 | APEX TOOL GROUP LLC / BC MOUNTAIN FINANCE INC 9.000% 15/02/2023 | USD | 432.472,76 | 0,05 |
| 400.000 | APPLE INC ZCP 15/11/2025 | EUR | 403.078,54 | 0,05 |
| 500.000 | ARCHES BUYER INC 6.125% 01/12/2028 | USD | 439.657,27 | 0,05 |
| 300.000 | ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.250% 01/04/2028 | USD | 267.383,80 | 0,03 |
| 505.000 | AT&T INC 1.600% 19/05/2028 | EUR | 540.753,08 | 0,07 |
| 700.000 | AT&T INC 1.800% 05/09/2026 | EUR | 752.721,33 | 0,09 |
| 525.000 | AUDACY CAPITAL CORP 6.750% 31/03/2029 | USD | 456.701,67 | 0,06 |
| 750.000 | AUTOLIV INC 0.750% 26/06/2023 | EUR | 760.275,44 | 0,09 |
| 900.000 | BANK OF AMERICA CORP 09/05/2026 FRN EMTN | EUR | 924.262,22 | 0,11 |
| 271.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/03/2031 FRN EMTN | EUR | 270.355,68 | 0,03 |
| 320.000 | BANK OF AMERICA CORP 24/08/2028 FRN EMTN | EUR | 323.172,05 | 0,04 |
| 800.000 | BAUSCH HEALTH AMERICAS INC 8.500% 31/01/2027 | USD | 736.265,47 | 0,09 |
| 550.000 | BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026 | USD | 494.738,50 | 0,06 |
| 210.000 | BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 7.625% 15/12/2025 | USD | 195.879,35 | 0,02 |
| 70.000 | BMW US CAPITAL LLC 1.000% 20/04/2027 EMTN | EUR | 73.692,65 | 0,01 |
| 641.000 | BUILDERS FIRSTSOURCE INC 4.250% 01/02/2032 | USD | 565.792,73 | 0,07 |
| 721.000 | CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC 4.750% 01/02/2028 | USD | 643.182,77 | 0,08 |
| 564.000 | CARRIAGE SERVICES INC 4.250% 15/05/2029 | USD | 491.142,59 | 0,06 |
| 2.325.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.750% 01/03/2030 | USD | 2.097.112,14 | 0,25 |
| 700.000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 1.250% 11/02/2025 | EUR | 724.716,92 | 0,09 |
| 167.000 | CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028 | USD | 144.792,45 | 0,02 |
| 406.000 | CENTENE CORP 2.500% 01/03/2031 | USD | 345.272,82 | 0,04 |
| 190.000 | CENTENE CORP 3.375% 15/02/2030 | USD | 169.686,63 | 0,02 |
| 1.310.000 | CENTENE CORP 4.625% 15/12/2029 | USD | 1.231.169,75 | 0,15 |
| 550.000 | CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026 | EUR | 561.000,00 | 0,07 |
| 192.000 | CHEMOURS CO/THE 4.625% 15/11/2029 | USD | 161.801,44 | 0,02 |
| 1.050.000 | CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.500% 01/10/2029 | USD | 963.794,46 | 0,12 |
| 800.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.000% 15/01/2029 | USD | 731.639,46 | 0,09 |
| 400.000 | CITIGROUP INC 0.750% 26/10/2023 EMTN | EUR | 407.347,62 | 0,05 |
| 600.000 | CITIGROUP INC 08/10/2027 FRN EMTN | EUR | 605.178,94 | 0,07 |
| 637.000 | CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 3.875% 01/07/2028 | USD | 549.719,95 | 0,07 |
| 380.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 3.750% 15/02/2031 | USD | 330.670,18 | 0,04 |
| 700.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 4.750% 15/03/2028 | USD | 639.034,95 | 0,08 |
| 448.000 | CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875% 01/03/2031 | USD | 399.146,80 | 0,05 |
| 419.000 | CNX MIDSTREAM PARTNERS LP / CNX MIDSTREAM FINANCE CORP 6.500% 15/03/2026 | USD | 379.745,05 | 0,05 |
| 900.000 | COCA-COLA CO/THE 1.125% 09/03/2027 | EUR | 951.606,11 | 0,12 |
| 500.000 | COMCAST CORP 0.750% 20/02/2032 | EUR | 504.429,72 | 0,06 |
| 329.000 | CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 5.000% 01/10/2028 | USD | 292.987,37 | 0,04 |
| 386.000 | CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 6.500% 01/10/2028 | USD | 363.080,38 | 0,04 |
| 700.000 | COTY INC 4.000% 15/04/2023 | EUR | 705.780,61 | 0,09 |
| 1.750.000 | CSC HOLDINGS LLC 5.375% 01/02/2028 | USD | 1.577.552,53 | 0,19 |
| 550.000 | DARLING INGREDIENTS INC 5.250% 15/04/2027 | USD | 493.287,52 | 0,06 |
| 1.000.000 | EMERSON ELECTRIC CO 2.000% 15/10/2029 EMTN | EUR | 1.124.802,74 | 0,14 |
| 664.000 | ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.750% 30/01/2028 | USD | 603.251,38 | 0,07 |
| 200.000 | ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.150% 01/06/2025 | USD | 178.002,09 | 0,02 |
| 600.000 | ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.850% 15/07/2026 | USD | 543.326,47 | 0,07 |
| 75.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.500% 15/01/2029 | USD | 67.221,32 | 0,01 |
| 75.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.750% 15/01/2031 | USD | 67.303,00 | 0,01 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 875.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 5.500% 15/07/2028 | USD | 830.430,04 | 0,10 |
| 444.000 | EQUITABLE FINANCIAL LIFE GLOBAL FUNDING 0.600% 16/06/2028 EMTN | EUR | 446.440,49 | 0,05 |
| 780.000 | FORD MOTOR CO 8.500% 21/04/2023 | USD | 739.791,15 | 0,09 |
| 500.000 | FORD MOTOR CO 9.000% 22/04/2025 | USD | 518.903,13 | 0,06 |
| 325.000 | FORD MOTOR CO 9.625% 22/04/2030 | USD | 397.707,82 | 0,05 |
| 1.100.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.000% 13/11/2030 | USD | 987.001,96 | 0,12 |
| 480.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.000% 18/03/2033 EMTN | EUR | 480.974,32 | 0,06 |
| 200.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 1.375% 15/05/2024 EMTN | EUR | 204.867,82 | 0,02 |
| 400.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 30/04/2024 FRN EMTN | EUR | 400.832,40 | 0,05 |
| 200.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.375% 15/06/2026 | USD | 175.118,31 | 0,02 |
| 300.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.750% 15/09/2030 | USD | 262.560,57 | 0,03 |
| 775.000 | HB FULLER CO 4.250% 15/10/2028 | USD | 680.213,62 | 0,08 |
| 1.705.000 | HCA INC 3.500% 01/09/2030 | USD | 1.558.439,86 | 0,19 |
| 550.000 | HOLOGIC INC 4.625% 01/02/2028 | USD | 499.286,83 | 0,06 |
| 180.000 | HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.250% 01/08/2026 | USD | 174.985,98 | 0,02 |
| 850.000 | HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 834.410,77 | 0,10 |
| 1.100.000 | IHEARTCOMMUNICATIONS INC 5.250% 15/08/2027 | USD | 987.079,97 | 0,12 |
| 488.000 | INGLES MARKETS INC 4.000% 15/06/2031 | USD | 427.137,90 | 0,05 |
| 900.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 1.250% 29/01/2027 | EUR | 952.730,26 | 0,12 |
| 1.100.000 | IQVIA INC 2.250% 15/01/2028 | EUR | 1.106.668,16 | 0,13 |
| 519.000 | JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO-ISSUER CORP 5.000% 15/08/2028 | USD | 454.146,83 | 0,06 |
| 2.100.000 | JPMORGAN CHASE & CO 11/03/2027 FRN EMTN | EUR | 2.182.777,17 | 0,26 |
| 300.000 | JPMORGAN CHASE & CO 18/05/2028 FRN EMTN | EUR | 321.746,01 | 0,04 |
| 588.000 | KB HOME 4.000% 15/06/2031 | USD | 520.578,20 | 0,06 |
| 525.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 3.875% 15/05/2027 | USD | 494.233,47 | 0,06 |
| 1.250.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 4.375% 01/06/2046 | USD | 1.230.631,21 | 0,15 |
| 500.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 4.625% 30/01/2029 | USD | 492.717,10 | 0,06 |
| 943.000 | KRATON POLYMERS LLC / KRATON POLYMERS CAPITAL CORP 4.250% 15/12/2025 | USD | 848.537,22 | 0,10 |
| 500.000 | KRATON POLYMERS LLC / KRATON POLYMERS CAPITAL CORP 5.250% 15/05/2026 | EUR | 514.586,87 | 0,06 |
| 700.000 | LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLP / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 5.250% 01/10/2025 | USD | 611.851,60 | 0,07 |
| 675.000 | LAREDO PETROLEUM INC 7.750% 31/07/2029 | USD | 583.538,33 | 0,07 |
| 900.000 | LINDE INC/CT 1.200% 12/02/2024 | EUR | 931.825,78 | 0,11 |
| 725.000 | LOGMEIN INC 5.500% 01/09/2027 | USD | 635.273,70 | 0,08 |
| 456.000 | LPL HOLDINGS INC 4.000% 15/03/2029 | USD | 404.323,18 | 0,05 |
| 750.000 | MATADOR RESOURCES CO 5.875% 15/09/2026 | USD | 667.704,76 | 0,08 |
| 562.000 | MATTEL INC 3.750% 01/04/2029 | USD | 505.560,15 | 0,06 |
| 46.000 | MATTEL INC 6.200% 01/10/2040 | USD | 51.032,23 | 0,01 |
| 324.000 | MAV ACQUISITION CORP 5.750% 01/08/2028 | USD | 274.454,73 | 0,03 |
| 1.400.000 | MCDONALD'S CORP 2.375% 27/11/2024 GMTN | EUR | 1.510.132,83 | 0,18 |
| 750.000 | MEDNAX INC 6.250% 15/01/2027 | USD | 680.608,40 | 0,08 |
| 289.000 | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 0.500% 25/05/2029 EMTN | EUR | 291.635,68 | 0,04 |
| 800.000 | MGM GROWTH PROPERTIES OPERATING PARTNERSHIP LP / MGP FINANCE CO-ISSUER INC 5.750% 01/02/2027 | USD | 793.408,08 | 0,10 |
| 200.000 | MGM RESORTS INTERNATIONAL 5.500% 15/04/2027 | USD | 187.703,41 | 0,02 |
| 485.000 | MGM RESORTS INTERNATIONAL 5.750% 15/06/2025 | USD | 456.741,48 | 0,06 |
| 427.000 | MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 379.185,17 | 0,05 |
| 500.000 | MMS USA HOLDINGS INC 0.625% 13/06/2025 | EUR | 509.790,78 | 0,06 |
| 500.000 | MOHEGAN GAMING & ENTERTAINMENT 8.000% 01/02/2026 | USD | 450.380,35 | 0,05 |
| 500.000 | MORGAN STANLEY 1.750% 30/01/2025 GMTN | EUR | 529.884,07 | 0,06 |
| 1.900.000 | MORGAN STANLEY 29/10/2027 FRN | EUR | 1.911.310,32 | 0,23 |
| 219.000 | NESCO HOLDINGS II INC 5.500% 15/04/2029 | USD | 196.105,09 | 0,02 |
| 700.000 | NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030 | EUR | 838.330,63 | 0,10 |
| 100.000 | NETFLIX INC 3.875% 15/11/2029 | EUR | 120.922,71 | 0,01 |
| 350.000 | NEW YORK LIFE GLOBAL FUNDING 0.250% 23/01/2027 GMTN | EUR | 352.990,67 | 0,04 |
| 600.000 | NEWMARK GROUP INC 6.125% 15/11/2023 | USD | 561.651,53 | 0,07 |
| 800.000 | NEXSTAR MEDIA INC 5.625% 15/07/2027 | USD | 731.118,96 | 0,09 |
| 750.000 | NFP CORP 6.875% 15/08/2028 | USD | 660.500,85 | 0,08 |
| 750.000 | NUSTAR LOGISTICS LP 6.000% 01/06/2026 | USD | 702.050,59 | 0,09 |
| 400.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.100% 15/02/2047 | USD | 329.600,43 | 0,04 |
| 200.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.300% 15/08/2039 | USD | 170.443,88 | 0,02 |
| 330.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.500% 15/07/2027 | USD | 356.654,77 | 0,04 |
| 330.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.875% 15/07/2030 | USD | 386.828,78 | 0,05 |
| 1.000.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 7.125% 15/03/2026 | USD | 997.887,71 | 0,12 |
| 800.000 | OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC 6.625% 13/05/2027 | USD | 741.444,08 | 0,09 |
| 300.000 | PEPSICO INC 0.875% 16/10/2039 | EUR | 295.816,02 | 0,04 |
| 900.000 | PEPSICO INC 1.125% 18/03/2031 | EUR | 957.583,91 | 0,12 |
| 675.000 | PITNEY BOWES INC 6.875% 15/03/2027 | USD | 614.843,85 | 0,07 |
| 1.200.000 | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 3.375% 31/08/2027 | USD | 994.228,15 | 0,12 |
| 500.000 | PRIMO WATER HOLDINGS INC 3.875% 31/10/2028 | EUR | 518.350,28 | 0,06 |
| 212.000 | PRIMO WATER HOLDINGS INC 4.375% 30/04/2029 | USD | 182.038,72 | 0,02 |
| 138.000 | PROLOGIS EURO FINANCE LLC 0.500% 16/02/2032 | EUR | 133.966,40 | 0,02 |
| 1.000.000 | RADIAN GROUP INC 4.500% 01/10/2024 | USD | 921.528,04 | 0,11 |
| 700.000 | RAIN CII CARBON LLC / CII CARBON CORP 7.250% 01/04/2025 | USD | 619.872,25 | 0,08 |
| 495.000 | RANGE RESOURCES CORP 8.250% 15/01/2029 | USD | 480.494,09 | 0,06 |
| 634.000 | REAL HERO MERGER SUB 2 INC 6.250% 01/02/2029 | USD | 567.461,11 | 0,07 |
| 500.000 | ROCKET SOFTWARE INC 6.500% 15/02/2029 | USD | 426.706,05 | 0,05 |
| 88.000 | SCRIPPS ESCROW II INC 3.875% 15/01/2029 | USD | 76.176,99 | 0,01 |
| 230.000 | SENSATA TECHNOLOGIES INC 3.750% 15/02/2031 | USD | 199.759,21 | 0,02 |
| 550.000 | SENSATA TECHNOLOGIES INC 4.375% 15/02/2030 | USD | 510.408,46 | 0,06 |
| 850.000 | SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.000% 15/05/2031 | USD | 758.641,50 | 0,09 |
| 1.050.000 | SIRIUS XM RADIO INC 5.000% 01/08/2027 | USD | 945.230,90 | 0,11 |
| 1.300.000 | SPRINT CAPITAL CORP 6.875% 15/11/2028 | USD | 1.432.674,21 | 0,17 |
| 550.000 | SS&C TECHNOLOGIES INC 5.500% 30/09/2027 | USD | 501.963,00 | 0,06 |
| 445.000 | STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 3.375% 15/01/2031 | USD | 365.398,86 | 0,04 |
| 160.000 | STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 4.750% 15/01/2028 | USD | 143.846,72 | 0,02 |
| 400.000 | STAPLES INC 10.750% 15/04/2027 | USD | 335.813,81 | 0,04 |
| 600.000 | STAPLES INC 7.500% 15/04/2026 | USD | 525.026,73 | 0,06 |
| 73.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 3.625% 15/07/2026 | USD | 63.442,30 | 0,01 |
| 845.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 5.500% 01/11/2023 | USD | 765.455,95 | 0,09 |
| 125.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.000% 15/01/2032 | USD | 111.439,57 | 0,01 |
| 750.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.500% 01/03/2030 | USD | 707.758,95 | 0,09 |
| 288.000 | TENET HEALTHCARE CORP 4.625% 15/07/2024 | USD | 252.566,15 | 0,03 |
| 1.050.000 | TENET HEALTHCARE CORP 5.125% 01/11/2027 | USD | 947.158,78 | 0,11 |
| 1.700.000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 1.950% 24/07/2029 | EUR | 1.884.374,81 | 0,23 |
| 241.000 | T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029 | USD | 210.044,51 | 0,03 |
| 103.000 | T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031 | USD | 89.669,65 | 0,01 |
| 2.800.000 | T-MOBILE USA INC 4.750% 01/02/2028 | USD | 2.564.997,53 | 0,31 |
| 600.000 | TRONOX INC 6.500% 01/05/2025 | USD | 543.703,14 | 0,07 |
| 542.000 | TTM TECHNOLOGIES INC 4.000% 01/03/2029 | USD | 465.655,52 | 0,06 |
| 1.100.000 | UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 5.250% 15/01/2030 | USD | 1.037.415,90 | 0,13 |
| 2.550.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE 0.875% 15/11/2030 | USD | 2.088.878,94 | 0,25 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 12.784.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE 1.500% 15/02/2030 | USD | 11.104.786,66 | 1,36 |
| 4.650.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE 1.750% 15/11/2029 | USD | 4.124.470,16 | 0,50 |
| 9.000.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.625% 31/12/2027 | USD | 7.493.852,19 | 0,91 |
| 5.980.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.250% 15/05/2041 | USD | 5.367.042,91 | 0,65 |
| 738.000 | UNIVISION COMMUNICATIONS INC 4.500% 01/05/2029 | USD | 648.427,85 | 0,08 |
| 1.200.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 1.250% 08/04/2030 | EUR | 1.266.033,98 | 0,15 |
| 100.000 | VF CORP 0.625% 25/02/2032 | EUR | 98.047,46 | 0,01 |
| 500.000 | VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO INC 4.125% 15/08/2030 | USD | 458.347,31 | 0,06 |
| 800.000 | VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO INC 4.250% 01/12/2026 | USD | 720.866,17 | 0,09 |
| 625.000 | VICTORIA'S SECRET & CO 4.625% 15/07/2029 | USD | 548.124,84 | 0,07 |
| 12.300.000 | WI TREASURY SE 2.625% 02/15/29 | USD | 11.574.863,02 | 1,41 |
| | | | **137.674.215,92** | **16,70** |
| | **Frankreich** | | | |
| 1.000.000 | ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025 | EUR | 970.049,00 | 0,12 |
| 500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.625% 03/11/2028 EMTN | EUR | 503.060,89 | 0,06 |
| 300.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 08/06/2026 EMTN | EUR | 309.440,11 | 0,04 |
| 800.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.750% 17/07/2025 EMTN | EUR | 824.326,82 | 0,10 |
| 800.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.250% 14/01/2025 EMTN | EUR | 836.147,41 | 0,10 |
| 600.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 2.375% 24/03/2026 EMTN | EUR | 653.857,26 | 0,08 |
| 500.000 | BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN | EUR | 497.968,10 | 0,06 |
| 800.000 | BNP PARIBAS SA 15/01/2032 FRN EMTN | EUR | 811.611,18 | 0,10 |
| 100.000 | BNP PARIBAS SA 1.625% 02/07/2031 EMTN | EUR | 105.258,04 | 0,01 |
| 300.000 | BNP PARIBAS SA 19/01/2030 FRN EMTN | EUR | 295.688,45 | 0,04 |
| 500.000 | BNP PARIBAS SA 19/02/2028 FRN EMTN | EUR | 500.921,52 | 0,06 |
| 200.000 | BNP PARIBAS SA 20/11/2030 FRN EMTN | EUR | 215.088,86 | 0,03 |
| 400.000 | BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN | EUR | 431.036,58 | 0,05 |
| 200.000 | BPCE SA 0.250% 14/01/2031 | EUR | 193.974,13 | 0,02 |
| 400.000 | BPCE SA 0.625% 15/01/2030 | EUR | 404.883,76 | 0,05 |
| 500.000 | CAPGEMINI SE 1.125% 23/06/2030 | EUR | 527.889,95 | 0,06 |
| 1.300.000 | CARREFOUR SA 2.625% 15/12/2027 EMTN | EUR | 1.483.687,82 | 0,18 |
| 300.000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1.865% 13/06/2022 EMTN | EUR | 298.999,77 | 0,04 |
| 600.000 | CCR RE SA 15/07/2040 FRN | EUR | 657.082,11 | 0,08 |
| 200.000 | CIE DE SAINT-GOBAIN 2.375% 04/10/2027 | EUR | 225.977,96 | 0,03 |
| 300.000 | CONSTELLIUM SE 4.250% 15/02/2026 | EUR | 303.750,00 | 0,04 |
| 100.000 | COVIVIO 1.625% 23/06/2030 | EUR | 108.284,40 | 0,01 |
| 300.000 | CREDIT AGRICOLE SA 2.000% 25/03/2029 EMTN | EUR | 324.375,21 | 0,04 |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE SA 22/04/2026 FRN EMTN | EUR | 206.203,30 | 0,03 |
| 1.100.000 | CREDIT AGRICOLE SA/LONDON 1.375% 13/03/2025 EMTN | EUR | 1.150.987,51 | 0,14 |
| 100.000 | CREDIT MUTUEL ARKEA SA 0.875% 07/05/2027 EMTN | EUR | 103.591,48 | 0,01 |
| 400.000 | ELO SACA 2.875% 29/01/2026 EMTN | EUR | 441.587,52 | 0,05 |
| 600.000 | EUTELSAT SA 1.500% 13/10/2028 | EUR | 611.397,64 | 0,07 |
| 600.000 | FAURECIA SE 2.375% 15/06/2027 | EUR | 603.111,29 | 0,07 |
| 300.000 | FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.375% 30/10/2026 | EUR | 319.147,39 | 0,04 |
| 300.000 | FIRMENICH PRODUCTIONS PARTICIPATIONS SAS 1.750% 30/04/2030 | EUR | 329.083,27 | 0,04 |
| 5.100.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/11/2030 | EUR | 5.074.178,14 | 0,62 |
| 10.500.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/11/2031 | EUR | 10.338.471,89 | 1,26 |
| 6.351.336 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 01/03/2029 | EUR | 7.328.848,81 | 0,90 |
| 3.320.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/05/2040 | EUR | 3.249.290,77 | 0,39 |
| 4.400.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.250% 25/05/2034 | EUR | 4.904.259,76 | 0,59 |
| 4.535.626 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.150% 25/07/2032 | EUR | 7.096.479,26 | 0,86 |
| 200.000 | HSBC CONTINENTAL EUROPE SA 0.100% 03/09/2027 EMTN | EUR | 198.474,99 | 0,02 |
| 100.000 | ICADE SANTE SAS 1.375% 17/09/2030 | EUR | 104.792,16 | 0,01 |
| 400.000 | KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026 | EUR | 402.000,00 | 0,05 |
| 800.000 | LOXAM SAS 4.250% 15/04/2024 | EUR | 807.355,78 | 0,10 |
| 700.000 | ORANGE SA 1.375% 20/03/2028 EMTN | EUR | 752.455,28 | 0,09 |
| 1.000.000 | ORANGE SA 1.625% 07/04/2032 EMTN | EUR | 1.107.013,26 | 0,13 |
| 379.000 | PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028 | EUR | 383.737,50 | 0,05 |
| 600.000 | PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026 | EUR | 609.610,02 | 0,07 |
| 1.500.000 | PSA BANQUE FRANCE SA ZCP 22/01/2025 EMTN | EUR | 1.498.769,82 | 0,18 |
| 700.000 | QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024 | EUR | 721.000,00 | 0,09 |
| 500.000 | RUBIS TERMINAL INFRA SAS 5.625% 15/05/2025 | EUR | 525.153,70 | 0,06 |
| 400.000 | SCHNEIDER ELECTRIC SE 0.250% 11/03/2029 EMTN | EUR | 402.348,33 | 0,05 |
| 200.000 | SOCIETE GENERALE SA 1.250% 12/06/2030 | EUR | 205.949,36 | 0,02 |
| 200.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP | EUR | 200.500,00 | 0,02 |
| 100.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 110.500,00 | 0,01 |
| 400.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 391.047,79 | 0,05 |
| 700.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 716.712,47 | 0,09 |
| 400.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 0.875% 29/03/2032 EMTN | EUR | 394.126,29 | 0,05 |
| 100.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.375% 04/12/2031 EMTN | EUR | 103.768,99 | 0,01 |
| 500.000 | VALLOUREC SA 8.500% 30/06/2026 | EUR | 512.653,92 | 0,06 |
| 500.000 | WPP FINANCE SA 2.375% 19/05/2027 EMTN | EUR | 558.539,66 | 0,07 |
| | | | **63.946.506,68** | **7,75** |
| | **Niederlande** | | | |
| 100.000 | AKELIUS RESIDENTIAL PROPERTY FINANCING BV 1.125% 11/01/2029 EMTN | EUR | 101.957,52 | 0,01 |
| 900.000 | ALLIANDER NV FRN PERP | EUR | 935.213,45 | 0,11 |
| 900.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR GIVAUDAN SA 1.125% 17/09/2025 | EUR | 940.365,66 | 0,11 |
| 500.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 01/10/2046 FRN EMTN | EUR | 569.368,03 | 0,07 |
| 100.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 19/02/2049 FRN | EUR | 111.824,34 | 0,01 |
| 500.000 | COCA-COLA HBC FINANCE BV 0.625% 21/11/2029 | EUR | 505.450,74 | 0,06 |
| 133.000 | CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN | EUR | 134.713,28 | 0,02 |
| 376.000 | CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN | EUR | 377.318,74 | 0,05 |
| 200.000 | CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN | EUR | 197.896,50 | 0,02 |
| 292.000 | DANFOSS FINANCE I BV 0.375% 28/10/2028 EMTN | EUR | 289.699,79 | 0,04 |
| 219.000 | DANFOSS FINANCE II BV 0.750% 28/04/2031 EMTN | EUR | 218.495,37 | 0,03 |
| 100.000 | DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN | EUR | 104.927,84 | 0,01 |
| 170.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032 | EUR | 166.622,22 | 0,02 |
| 458.000 | DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031 | EUR | 438.061,70 | 0,05 |
| 600.000 | EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN | EUR | 645.119,11 | 0,08 |
| 900.000 | ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP | EUR | 966.375,00 | 0,12 |
| 300.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.500% 31/07/2029 EMTN | EUR | 324.569,10 | 0,04 |
| 400.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 5.750% 14/02/2033 EMTN | EUR | 610.058,22 | 0,07 |
| 100.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.000% 22/04/2027 | EUR | 104.857,47 | 0,01 |
| 100.000 | GIVAUDAN FINANCE EUROPE BV 1.625% 22/04/2032 | EUR | 109.832,57 | 0,01 |
| 143.000 | HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 0.750% 06/09/2029 EMTN | EUR | 139.548,08 | 0,02 |
| 200.000 | HEIMSTADEN BOSTAD TREASURY BV 1.375% 03/03/2027 EMTN | EUR | 207.442,44 | 0,03 |
| 200.000 | HEINEKEN NV 1.750% 07/05/2040 EMTN | EUR | 212.629,93 | 0,03 |
| 600.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 619.500,00 | 0,08 |
| 700.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 715.130,54 | 0,09 |
| 1.400.000 | ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN | EUR | 1.485.161,22 | 0,18 |
| 667.000 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 0.375% 18/03/2030 | EUR | 662.538,23 | 0,08 |
| 400.000 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV 1.750% 02/04/2027 | EUR | 433.993,12 | 0,05 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 165.000 | KONINKLIJKE DSM NV 0.625% 23/06/2032 EMTN | EUR | 166.819,58 | 0,02 |
| 300.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 0.500% 22/05/2026 | EUR | 306.924,80 | 0,04 |
| 100.000 | KONINKLIJKE PHILIPS NV 2.000% 30/03/2030 EMTN | EUR | 113.158,35 | 0,01 |
| 550.000 | LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV 4.125% 01/04/2028 | EUR | 589.063,61 | 0,07 |
| 300.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 1.625% 17/09/2031 | EUR | 323.503,75 | 0,04 |
| 15.410.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2030 | EUR | 15.626.797,13 | 1,89 |
| 14.000.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2031 | EUR | 14.107.611,42 | 1,71 |
| 3.130.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.500% 15/01/2033 | EUR | 4.023.650,93 | 0,49 |
| 1.600.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.000% 15/01/2037 | EUR | 2.541.825,22 | 0,31 |
| 800.000 | NOBIAN FINANCE BV 3.625% 15/07/2026 | EUR | 793.359,99 | 0,10 |
| 422.000 | RECKITT BENCKISER TREASURY SERVICES NEDERLAND BV 0.750% 19/05/2030 | EUR | 432.707,49 | 0,05 |
| 400.000 | SAGAX EURO MTN NL BV 0.750% 26/01/2028 EMTN | EUR | 397.529,03 | 0,05 |
| 200.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 0.250% 20/02/2029 EMTN | EUR | 201.114,30 | 0,02 |
| 200.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 0.500% 05/09/2034 EMTN | EUR | 198.813,07 | 0,02 |
| 900.000 | SIGMA HOLDCO BV 5.750% 15/05/2026 | EUR | 858.688,45 | 0,10 |
| 800.000 | TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 3.750% 15/08/2026 | EUR | 818.807,25 | 0,10 |
| 1.000.000 | UNILEVER FINANCE NETHERLANDS BV 1.750% 25/03/2030 | EUR | 1.121.159,17 | 0,14 |
| 200.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 205.198,48 | 0,02 |
| 200.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 220.973,28 | 0,03 |
| 300.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 322.188,16 | 0,04 |
| 1.000.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.109.745,63 | 0,13 |
| 100.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.500% 21/01/2041 EMTN | EUR | 97.550,42 | 0,01 |
| 100.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 4.125% 16/11/2038 | EUR | 138.126,56 | 0,02 |
| 200.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE 2.625% 16/11/2027 | EUR | 226.660,70 | 0,03 |
| 800.000 | VONOVIA FINANCE BV 0.750% 15/01/2024 | EUR | 816.499,96 | 0,10 |
| 400.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN | EUR | 410.035,93 | 0,05 |
| 200.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.500% 14/01/2028 | EUR | 213.413,11 | 0,03 |
| 100.000 | VONOVIA FINANCE BV 2.250% 07/04/2030 | EUR | 112.699,93 | 0,01 |
| 200.000 | VONOVIA FINANCE BV 2.250% 15/12/2023 EMTN | EUR | 210.825,66 | 0,03 |
| 800.000 | VZ VENDOR FINANCING II BV 2.875% 15/01/2029 | EUR | 791.134,42 | 0,10 |
| 500.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2.500% 23/10/2027 | EUR | 511.030,22 | 0,06 |
| 700.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 3.000% 23/10/2029 | EUR | 728.087,54 | 0,09 |
| 200.000 | ZIGGO BV 2.875% 15/01/2030 | EUR | 201.950,44 | 0,02 |
| | | | **61.266.324,19** | **7,43** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 300.000 | AVIVA PLC 04/12/2045 FRN EMTN | EUR | 333.158,77 | 0,04 |
| 190.000 | BARCLAYS PLC 09/06/2025 FRN EMTN | EUR | 193.455,09 | 0,02 |
| 428.000 | EC FINANCE PLC 3.000% 15/10/2026 | EUR | 431.210,00 | 0,05 |
| 138.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC 3.750% 15/07/2026 | EUR | 141.841,14 | 0,02 |
| 268.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 2.500% 15/01/2026 | EUR | 270.354,58 | 0,03 |
| 929.000 | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 3.500% 15/06/2026 | EUR | 953.321,02 | 0,12 |
| 165.000 | LLOYDS BANK CORPORATE MARKETS PLC 2.375% 09/04/2026 EMTN | EUR | 181.812,25 | 0,02 |
| 950.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 15/01/2024 FRN EMTN | EUR | 960.062,66 | 0,12 |
| 500.000 | MATALAN FINANCE PLC 6.750% 31/01/2023 | GBP | 547.621,32 | 0,07 |
| 700.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 6.500% 15/02/2023 | EUR | 712.218,24 | 0,09 |
| 300.000 | NATWEST GROUP PLC 04/03/2025 FRN EMTN | EUR | 314.345,36 | 0,04 |
| 191.000 | NATWEST GROUP PLC 26/02/2030 FRN EMTN | EUR | 190.898,04 | 0,02 |
| 250.000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 13/09/2029 FRN EMTN | EUR | 247.261,01 | 0,03 |
| 315.000 | STANDARD CHARTERED PLC 09/09/2030 FRN | EUR | 333.099,71 | 0,04 |
| 1.000.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.375% 27/07/2029 EMTN | EUR | 980.029,57 | 0,12 |
| 600.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN | EUR | 616.879,06 | 0,07 |
| 7.500.000 | UNITED KINGDOM GILT 0.250% 31/07/2031 | GBP | 8.107.704,72 | 0,99 |
| 2.640.000 | UNITED KINGDOM GILT 0.625% 31/07/2035 | GBP | 2.831.359,25 | 0,34 |
| 2.600.000 | UNITED KINGDOM GILT 1.250% 22/10/2041 | GBP | 2.965.338,28 | 0,36 |
| 3.700.000 | UNITED KINGDOM GILT 4.250% 07/06/2032 | GBP | 5.702.281,95 | 0,69 |
| 4.740.000 | UNITED KINGDOM GILT 4.500% 07/09/2034 | GBP | 7.734.448,59 | 0,94 |
| 700.000 | VMED O2 UK FINANCING I PLC 3.250% 31/01/2031 | EUR | 718.642,69 | 0,09 |
| 700.000 | VODAFONE GROUP PLC 1.125% 20/11/2025 EMTN | EUR | 731.805,58 | 0,09 |
| | | | **36.199.148,88** | **4,40** |
| | **Australien** | | | |
| 5.900.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 1.500% 21/06/2031 | AUD | 3.694.949,88 | 0,45 |
| 5.200.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.250% 21/05/2028 | AUD | 3.485.931,64 | 0,42 |
| 21.950.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.500% 21/05/2030 | AUD | 14.974.866,95 | 1,82 |
| 2.800.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 3.250% 21/04/2029 | AUD | 2.003.476,30 | 0,24 |
| 100.000 | TOYOTA FINANCE AUSTRALIA LTD 2.280% 21/10/2027 EMTN | EUR | 112.535,70 | 0,01 |
| 1.000.000 | TRANSURBAN FINANCE CO PTY LTD 1.450% 16/05/2029 EMTN | EUR | 1.053.848,01 | 0,13 |
| 174.000 | WESTPAC BANKING CORP 13/05/2031 FRN | EUR | 174.079,29 | 0,02 |
| | | | **25.499.687,77** | **3,09** |
| | **Kanada** | | | |
| 51.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 4.875% 01/06/2028 | USD | 45.630,83 | 0,01 |
| 150.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 5.750% 15/08/2027 | USD | 135.822,05 | 0,02 |
| 252.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 6.125% 15/04/2025 | USD | 222.093,02 | 0,03 |
| 14.100.000 | CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.250% 01/06/2030 | CAD | 9.481.376,22 | 1,14 |
| 6.600.000 | CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.500% 01/06/2031 | CAD | 4.491.383,51 | 0,54 |
| 13.900.000 | CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.000% 01/06/2028 | CAD | 9.926.412,20 | 1,20 |
| 660.000 | FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028 | EUR | 731.072,93 | 0,09 |
| 200.000 | GREAT-WEST LIFECO INC 1.750% 07/12/2026 | EUR | 216.867,32 | 0,03 |
| | | | **25.250.658,08** | **3,06** |
| | **Finnland** | | | |
| 7.300.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15/09/2031 | EUR | 7.370.131,39 | 0,89 |
| 7.700.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 0.500% 15/09/2029 | EUR | 8.102.884,33 | 0,99 |
| 5.280.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 1.125% 15/04/2034 | EUR | 5.903.048,87 | 0,72 |
| 200.000 | OP CORPORATE BANK PLC 0.100% 16/11/2027 EMTN | EUR | 198.927,96 | 0,02 |
| 500.000 | OP CORPORATE BANK PLC 0.600% 18/01/2027 EMTN | EUR | 508.821,18 | 0,06 |
| 825.000 | OP CORPORATE BANK PLC 09/06/2030 FRN | EUR | 854.617,57 | 0,10 |
| 100.000 | SAMPO OYJ 03/09/2052 FRN EMTN | EUR | 106.264,74 | 0,01 |
| 141.000 | SAMPO OYJ 23/05/2049 FRN | EUR | 160.750,98 | 0,02 |
| 467.000 | SATO OYJ 1.375% 24/02/2028 | EUR | 485.767,23 | 0,06 |
| 150.000 | STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN | EUR | 150.084,83 | 0,02 |
| 100.000 | UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN | EUR | 98.323,74 | 0,01 |
| | | | **23.939.622,82** | **2,90** |
| | **Deutschland** | | | |
| 300.000 | ALBEMARLE NEW HOLDING GMBH 1.625% 25/11/2028 | EUR | 321.105,83 | 0,04 |
| 100.000 | ALSTRIA OFFICE REIT-AG 1.500% 15/11/2027 | EUR | 104.047,13 | 0,01 |
| 400.000 | COMMERZBANK AG 0.500% 04/12/2026 EMTN | EUR | 405.704,33 | 0,05 |
| 169.000 | COVESTRO AG 0.875% 03/02/2026 EMTN | EUR | 174.347,27 | 0,02 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 169.000 | COVESTRO AG 1.375% 12/06/2030 EMTN | EUR | 180.367,15 | 0,02 |
| 10.612.670 | DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.500% 15/04/2030 | EUR | 13.115.240,60 | 1,59 |
| 500.000 | DEUTSCHE TELEKOM AG 2.250% 29/03/2039 EMTN | EUR | 584.613,58 | 0,07 |
| 500.000 | HANNOVER RUECK SE 08/10/2040 FRN | EUR | 522.396,39 | 0,06 |
| 800.000 | HANNOVER RUECK SE 09/10/2039 FRN | EUR | 802.574,36 | 0,10 |
| 200.000 | IHO VERWALTUNGS GMBH 3.625% 15/05/2025 | EUR | 203.463,58 | 0,02 |
| 500.000 | IHO VERWALTUNGS GMBH 3.875% 15/05/2027 | EUR | 513.174,13 | 0,06 |
| 300.000 | MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.500% 16/07/2028 EMTN | EUR | 306.097,88 | 0,04 |
| 300.000 | MERCK FINANCIAL SERVICES GMBH 0.875% 05/07/2031 EMTN | EUR | 313.161,24 | 0,04 |
| 500.000 | MERCK KGAA 09/09/2080 FRN | EUR | 514.422,92 | 0,06 |
| 600.000 | MERCK KGAA 12/12/2074 FRN | EUR | 654.782,68 | 0,08 |
| 600.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2049 FRN | EUR | 692.346,35 | 0,08 |
| 700.000 | O2 TELEFONICA DEUTSCHLAND FINANZIERUNGS GMBH 1.750% 05/07/2025 | EUR | 739.219,23 | 0,09 |
| 700.000 | SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025 | EUR | 732.138,34 | 0,09 |
| 158.000 | SYMRISE AG 1.375% 01/07/2027 | EUR | 166.671,26 | 0,02 |
| 250.000 | TUI CRUISES GMBH 6.500% 15/05/2026 | EUR | 257.500,00 | 0,03 |
| 200.000 | VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.875% 31/01/2024 EMTN | EUR | 208.796,38 | 0,03 |
| 250.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 3.375% 06/04/2028 EMTN | EUR | 294.325,63 | 0,04 |
| 324.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 0.625% 19/07/2029 EMTN | EUR | 322.275,53 | 0,04 |
| 200.000 | VONOVIA SE 0.250% 01/09/2028 EMTN | EUR | 196.448,52 | 0,02 |
| 400.000 | VONOVIA SE 0.625% 14/12/2029 EMTN | EUR | 399.864,16 | 0,05 |
| 300.000 | VONOVIA SE 0.750% 01/09/2032 EMTN | EUR | 292.433,31 | 0,04 |
| | | | **23.017.517,78** | **2,79** |
| | **Österreich** | | | |
| 7.600.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2030 | EUR | 7.644.374,04 | 0,93 |
| 12.700.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2031 | EUR | 12.676.226,24 | 1,54 |
| 200.000 | ERSTE GROUP BANK AG 0.375% 16/04/2024 EMTN | EUR | 203.147,53 | 0,02 |
| 100.000 | ERSTE GROUP BANK AG 08/09/2031 FRN EMTN | EUR | 103.800,90 | 0,01 |
| 500.000 | ERSTE GROUP BANK AG 10/06/2030 FRN EMTN | EUR | 506.370,80 | 0,06 |
| 800.000 | ERSTE GROUP BANK AG 16/11/2028 FRN EMTN | EUR | 788.790,57 | 0,10 |
| | | | **21.922.710,08** | **2,66** |
| | **Irland** | | | |
| 700.000 | AIB GROUP PLC 1.250% 28/05/2024 EMTN | EUR | 724.237,84 | 0,09 |
| 358.000 | AIB GROUP PLC 17/11/2027 FRN EMTN | EUR | 359.418,22 | 0,04 |
| 152.000 | BANK OF IRELAND GROUP PLC 10/05/2027 FRN EMTN | EUR | 151.431,51 | 0,02 |
| 447.000 | CCEP FINANCE IRELAND DAC 0.875% 06/05/2033 | EUR | 444.499,46 | 0,05 |
| 394.000 | FRESENIUS FINANCE IRELAND PLC 0.875% 01/10/2031 EMTN | EUR | 391.461,21 | 0,05 |
| 4.970.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND ZCP 18/10/2031 | EUR | 4.881.703,63 | 0,59 |
| 7.600.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 0.200% 18/10/2030 | EUR | 7.687.668,81 | 0,93 |
| 3.200.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 0.400% 15/05/2035 | EUR | 3.196.642,56 | 0,39 |
| 200.000 | PARTNERRE IRELAND FINANCE DAC 1.250% 15/09/2026 | EUR | 208.939,85 | 0,03 |
| 100.000 | SMURFIT KAPPA ACQUISITIONS ULC 2.875% 15/01/2026 | EUR | 110.691,83 | 0,01 |
| 100.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 0.500% 22/09/2029 | EUR | 99.431,38 | 0,01 |
| | | | **18.256.126,30** | **2,21** |
| | **Spanien** | | | |
| 100.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 04/06/2025 FRN GMTN | EUR | 102.912,04 | 0,01 |
| 300.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 16/01/2030 FRN GMTN | EUR | 303.497,97 | 0,04 |
| 100.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 24/03/2027 FRN GMTN | EUR | 99.816,81 | 0,01 |
| 100.000 | BANCO SANTANDER SA 0.200% 11/02/2028 EMTN | EUR | 99.185,44 | 0,01 |
| 100.000 | CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN | EUR | 98.724,71 | 0,01 |
| 200.000 | CAIXABANK SA 10/07/2026 FRN EMTN | EUR | 204.614,76 | 0,02 |
| 700.000 | CAIXABANK SA 1.125% 27/03/2026 EMTN | EUR | 730.516,97 | 0,09 |
| 700.000 | CAIXABANK SA 14/07/2028 FRN EMTN | EUR | 729.902,32 | 0,09 |
| 500.000 | CAIXABANK SA 18/06/2031 FRN EMTN | EUR | 506.185,29 | 0,06 |
| 100.000 | MERLIN PROPERTIES SOCIMI SA 2.375% 18/09/2029 EMTN | EUR | 109.310,19 | 0,01 |
| 800.000 | SANTANDER CONSUMER FINANCE SA 0.500% 14/11/2026 EMTN | EUR | 812.161,04 | 0,10 |
| 8.300.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 0.500% 31/10/2031 | EUR | 8.335.997,76 | 1,02 |
| 700.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.460% 13/04/2026 EMTN | EUR | 745.185,14 | 0,09 |
| | | | **12.878.010,44** | **1,56** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 200.000 | ADLER GROUP SA 1.875% 14/01/2026 | EUR | 169.000,00 | 0,02 |
| 400.000 | ADLER GROUP SA 2.250% 14/01/2029 | EUR | 326.000,00 | 0,04 |
| 300.000 | ADLER GROUP SA 2.250% 27/04/2027 | EUR | 250.500,00 | 0,03 |
| 800.000 | ALTICE FINANCING SA 2.250% 15/01/2025 | EUR | 770.000,00 | 0,09 |
| 700.000 | ALTICE FRANCE HOLDING SA 8.000% 15/05/2027 | EUR | 745.639,17 | 0,09 |
| 100.000 | AROUNDTOWN SA 1.625% 31/01/2028 EMTN | EUR | 105.630,94 | 0,01 |
| 700.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.750% 25/03/2027 EMTN | EUR | 747.435,65 | 0,09 |
| 700.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 0.200% 18/03/2026 | EUR | 704.182,33 | 0,09 |
| 1.000.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 0.750% 18/09/2031 | EUR | 1.007.750,75 | 0,12 |
| 200.000 | DH EUROPE FINANCE II SARL 1.800% 18/09/2049 | EUR | 210.774,79 | 0,03 |
| 200.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA FRN PERP EMTN | EUR | 197.000,00 | 0,02 |
| 100.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 0.125% 11/01/2028 EMTN | EUR | 96.734,12 | 0,01 |
| 200.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 1.375% 03/08/2026 EMTN | EUR | 209.962,15 | 0,03 |
| 315.000 | HOLCIM FINANCE LUXEMBOURG SA 0.500% 23/04/2031 | EUR | 305.552,34 | 0,04 |
| 121.000 | JOHN DEERE CASH MANAGEMENT SARL 2.200% 02/04/2032 EMTN | EUR | 142.160,61 | 0,02 |
| 600.000 | KLEOPATRA FINCO SARL 4.250% 01/03/2026 | EUR | 588.025,27 | 0,07 |
| 1.000.000 | LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01/04/2024 | EUR | 1.008.187,16 | 0,12 |
| 199.000 | LOGICOR FINANCING SARL 0.875% 14/01/2031 EMTN | EUR | 192.527,58 | 0,02 |
| 200.000 | LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15/07/2027 EMTN | EUR | 210.576,87 | 0,03 |
| 100.000 | LOGICOR FINANCING SARL 3.250% 13/11/2028 EMTN | EUR | 115.645,91 | 0,01 |
| 1.500.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 0.250% 02/07/2025 | EUR | 1.518.858,74 | 0,19 |
| 1.000.000 | MEDTRONIC GLOBAL HOLDINGS SCA 1.375% 15/10/2040 | EUR | 1.013.520,84 | 0,12 |
| 600.000 | MOTION FINCO SARL 7.000% 15/05/2025 | EUR | 631.029,85 | 0,08 |
| 115.000 | SEGRO CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031 | EUR | 112.552,41 | 0,01 |
| 650.000 | SUMMER BC HOLDCO B SARL 5.750% 31/10/2026 | EUR | 680.875,00 | 0,08 |
| 100.000 | TRATON FINANCE LUXEMBOURG SA 1.250% 24/03/2033 EMTN | EUR | 100.771,36 | 0,01 |
| | | | **12.160.893,84** | **1,47** |
| | **Schweden** | | | |
| 900.000 | ATLAS COPCO AB 0.625% 30/08/2026 EMTN | EUR | 928.573,98 | 0,11 |
| 600.000 | ESSITY AB 1.625% 30/03/2027 EMTN | EUR | 645.296,16 | 0,08 |
| 100.000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.875% 23/01/2026 | EUR | 105.666,24 | 0,01 |
| 200.000 | MOLNLYCKE HOLDING AB 0.875% 05/09/2029 EMTN | EUR | 202.181,32 | 0,02 |
| 49.125.000 | SWEDEN GOVERNMENT BOND 0.125% 12/05/2031 | SEK | 4.729.499,63 | 0,57 |
| 45.705.000 | SWEDEN GOVERNMENT BOND 0.750% 12/11/2029 | SEK | 4.671.968,47 | 0,57 |
| 200.000 | TELIASONERA AB 1.625% 23/02/2035 EMTN | EUR | 217.895,08 | 0,03 |
| 137.000 | VERISURE HOLDING AB 3.250% 15/02/2027 | EUR | 137.692,80 | 0,02 |
| | | | **11.638.773,68** | **1,41** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Italien** | | | |
| 800.000 | ATLANTIA SPA 1.625% 03/02/2025 EMTN | EUR | 820.000,00 | 0,09 |
| 600.000 | AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 1.750% 26/06/2026 EMTN | EUR | 620.153,93 | 0,08 |
| 300.000 | ENEL SPA 24/05/2080 FRN | EUR | 326.548,30 | 0,04 |
| 192.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.125% 16/11/2023 EMTN | EUR | 192.771,19 | 0,02 |
| 240.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.250% 28/02/2023 EMTN | EUR | 241.347,23 | 0,03 |
| 155.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.500% 18/09/2023 EMTN | EUR | 156.608,29 | 0,02 |
| 300.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN | EUR | 303.719,32 | 0,04 |
| 700.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.375% 18/01/2024 EMTN | EUR | 724.640,53 | 0,09 |
| 300.000 | INTESA SANPAOLO SPA 1.750% 20/03/2028 EMTN | EUR | 321.430,53 | 0,04 |
| 700.000 | ITALGAS SPA 0.875% 24/04/2030 EMTN | EUR | 713.701,74 | 0,09 |
| 100.000 | MEDIOBANCA BANCA DI CREDITO FINANZIARIO SPA 1.000% 08/09/2027 EMTN | EUR | 102.750,35 | 0,01 |
| 400.000 | PRO-GEST SPA 3.250% 15/12/2024 | EUR | 390.353,99 | 0,05 |
| 223.000 | UNICREDIT SPA 05/07/2029 FRN EMTN | EUR | 225.590,21 | 0,03 |
| 250.000 | UNICREDIT SPA 0.850% 19/01/2031 EMTN | EUR | 246.491,75 | 0,03 |
| 214.000 | UNICREDIT SPA 16/06/2026 FRN EMTN | EUR | 221.323,43 | 0,03 |
| 200.000 | UNICREDIT SPA 25/06/2025 FRN EMTN | EUR | 206.119,99 | 0,02 |
| | | | **5.813.550,78** | **0,71** |
| | **Japan** | | | |
| 1.300.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.541% 23/10/2028 | EUR | 1.308.588,41 | 0,16 |
| 600.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 2.250% 21/11/2026 | EUR | 661.363,25 | 0,08 |
| 200.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.000% 21/11/2030 | EUR | 239.242,93 | 0,03 |
| | | | **2.209.194,59** | **0,27** |
| | **Belgien** | | | |
| 400.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN | EUR | 478.421,80 | 0,06 |
| 344.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.875% 02/04/2032 EMTN | EUR | 414.816,83 | 0,05 |
| 200.000 | BELFIUS BANK SA 0.010% 15/10/2025 EMTN | EUR | 200.152,53 | 0,02 |
| 500.000 | KBC GROUP NV 07/12/2031 FRN EMTN | EUR | 497.173,34 | 0,07 |
| 200.000 | SOLVAY SA 1.625% 02/12/2022 | EUR | 203.551,26 | 0,02 |
| | | | **1.794.115,76** | **0,22** |
| | **Schweiz** | | | |
| 500.000 | UBS AG/LONDON 0.010% 31/03/2026 EMTN | EUR | 498.758,98 | 0,06 |
| 852.000 | UBS AG/LONDON 0.500% 31/03/2031 EMTN | EUR | 844.789,93 | 0,10 |
| | | | **1.343.548,91** | **0,16** |
| | **Jersey** | | | |
| 590.000 | APTIV PLC 1.500% 10/03/2025 | EUR | 616.370,62 | 0,08 |
| 500.000 | WHEEL BIDCO LTD 6.750% 15/07/2026 | GBP | 585.898,88 | 0,07 |
| | | | **1.202.269,50** | **0,15** |
| | **Island** | | | |
| 400.000 | ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN | EUR | 405.575,98 | 0,05 |
| 400.000 | LANDSBANKINN HF 0.500% 20/05/2024 EMTN | EUR | 403.851,34 | 0,05 |
| 200.000 | LANDSBANKINN HF 1.000% 30/05/2023 EMTN | EUR | 203.497,05 | 0,02 |
| | | | **1.012.924,37** | **0,12** |
| | **Dänemark** | | | |
| 120.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.625% 09/03/2030 EMTN | EUR | 121.277,40 | 0,01 |
| 500.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.875% 01/07/2029 EMTN | EUR | 516.167,50 | 0,07 |
| 200.000 | JYSKE BANK AS 15/10/2025 FRN EMTN | EUR | 202.126,45 | 0,02 |
| | | | **839.571,35** | **0,10** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 750.000 | CLARIOS GLOBAL LP / CLARIOS US FINANCE CO 8.500% 15/05/2027 | USD | 688.509,56 | 0,09 |
| | | | **688.509,56** | **0,09** |
| | **Portugal** | | | |
| 600.000 | BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN | EUR | 670.435,86 | 0,08 |
| | | | **670.435,86** | **0,08** |
| | **Singapur** | | | |
| 600.000 | DBS GROUP HOLDINGS LTD 11/04/2028 FRN GMTN | EUR | 613.737,05 | 0,07 |
| | | | **613.737,05** | **0,07** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 350.000 | XLIT LTD 29/06/2047 FRN | EUR | 392.983,59 | 0,05 |
| | | | **392.983,59** | **0,05** |
| | **Liberia** | | | |
| 266.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 11.500% 01/06/2025 | USD | 262.042,37 | 0,04 |
| | | | **262.042,37** | **0,04** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 200.000 | BNZ INTERNATIONAL FUNDING LTD/LONDON 0.375% 14/09/2024 GMTN | EUR | 203.224,86 | 0,02 |
| | | | **203.224,86** | **0,02** |
| | **Norwegen** | | | |
| 100.000 | NORSK HYDRO ASA 1.125% 11/04/2025 | EUR | 103.253,63 | 0,01 |
| | | | **103.253,63** | **0,01** |
| | | | **490.799.558,64** | **59,53** |
| | **Börsengehandelte Wertpapiere** | | | |
| | **Jersey** | | | |
| 177.506 | WISDOMTREE CARBON | USD | 3.789.204,40 | 0,46 |
| | | | **3.789.204,40** | **0,46** |
| | | | **3.789.204,40** | **0,46** |
| | **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | |
| | **Offene Fonds** | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 430.257 | AMUNDI INDEX US CORP SRI UCITS ETF DR | USD | 22.993.198,41 | 2,78 |
| | | | **22.993.198,41** | **2,78** |
| | **Jersey** | | | |
| 357.961 | WISDOMTREE WTI CRUDE OIL | USD | 2.147.395,36 | 0,26 |
| | | | **2.147.395,36** | **0,26** |
| | | | **25.140.593,77** | **3,04** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **794.192.720,30** | **96,31** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swaps** | | | | | | |
| CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 37 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | USD | 4.500.000,00 | (361.388,07) |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | EUR | 4.100.000,00 | (483.970,48) |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | EUR | 4.450.000,00 | (525.285,03) |
| CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 37 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | USD | 6.690.000,00 | (537.263,60) |
| | | | | | | **(1.907.907,18)** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 72.800.000,00 | USD | 61.823.075,35 | EUR | 26/11/2021 | 61.823.075,35 | 926.727,91 |
| 23.623.010,34 | USD | 19.931.186,75 | EUR | 19/10/2021 | 19.931.186,75 | 445.914,41 |
| 2.724.769.097,00 | JPY | 20.883.518,50 | EUR | 19/10/2021 | 20.883.518,50 | 184.110,04 |
| 31.634.153,41 | EUR | 27.150.000,00 | GBP | 26/11/2021 | 31.634.153,41 | 79.282,80 |
| 901.121.943,84 | CZK | 35.455.837,17 | EUR | 19/10/2021 | 35.455.837,17 | 71.628,52 |
| 6.600.000,00 | CAD | 4.444.960,48 | EUR | 26/11/2021 | 4.444.960,48 | 45.241,69 |
| 500.000.000,00 | JPY | 3.835.835,15 | EUR | 26/11/2021 | 3.835.835,15 | 28.244,85 |
| 4.100.000,00 | AUD | 2.525.744,73 | EUR | 26/11/2021 | 2.525.744,73 | 27.606,29 |
| 13.937.033,16 | EUR | 1.800.000.000,00 | JPY | 26/11/2021 | 13.937.033,16 | 26.345,17 |
| 8.130.163,66 | AUD | 5.052.083,61 | EUR | 19/10/2021 | 5.052.083,61 | 14.108,10 |
| 39.000.000,00 | SEK | 3.839.327,49 | EUR | 26/11/2021 | 3.839.327,49 | 4.615,52 |
| 6.214,57 | EUR | 30.798,13 | RON | 19/10/2021 | 6.214,57 | (0,94) |
| 1.160.548,78 | EUR | 998.000,00 | GBP | 29/10/2021 | 1.160.548,78 | (21,60) |
| 45.203,79 | EUR | 5.897.644,00 | JPY | 19/10/2021 | 45.203,79 | (396,17) |
| 327.356,24 | EUR | 8.314.931,77 | CZK | 19/10/2021 | 327.356,24 | (466,71) |
| 3.740.527,42 | RON | 755.889,42 | EUR | 19/10/2021 | 755.889,42 | (997,15) |
| 274.323,76 | EUR | 442.035,06 | AUD | 19/10/2021 | 274.323,76 | (1.123,87) |
| 1.092.340,01 | EUR | 1.290.561,32 | USD | 19/10/2021 | 1.092.340,01 | (20.892,31) |
| 15.600.000,00 | NZD | 9.315.629,66 | EUR | 26/11/2021 | 9.315.629,66 | (43.205,85) |
| 13.172.684,78 | EUR | 135.200.000,00 | SEK | 26/11/2021 | 13.172.684,78 | (152.984,32) |
| 9.119.335,27 | EUR | 15.600.000,00 | NZD | 26/11/2021 | 9.119.335,27 | (153.088,55) |
| 4.036.999.218,83 | HUF | 11.578.587,36 | EUR | 19/10/2021 | 11.578.587,36 | (349.620,51) |
| 28.020.395,18 | EUR | 45.800.000,00 | AUD | 26/11/2021 | 28.020.395,18 | (502.404,06) |
| 114.586.260,62 | PLN | 25.393.117,49 | EUR | 19/10/2021 | 25.393.117,49 | (504.394,80) |
| 28.681.135,92 | EUR | 42.900.000,00 | CAD | 26/11/2021 | 28.681.135,92 | (505.178,21) |
| 69.376.783,77 | EUR | 81.115.163,54 | USD | 29/10/2021 | 69.376.783,77 | (579.330,25) |
| 224.431.538,36 | EUR | 264.000.000,00 | USD | 26/11/2021 | 224.431.538,36 | (3.122.693,25) |
| | | | | | **626.113.840,16** | **(4.082.973,25)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Futures auf Aktienindizes** | | | | |
| (502) | EURO STOXX 50 17/12/2021 | EUR | 20.320.960,00 | 476.491,73 |
| (247) | MSCI EMRGING MARKETS 17/12/2021 | USD | 13.273.359,51 | 366.592,12 |
| 40 | MSCI INDIA FUTURE 17/12/2021 | USD | 3.493.117,05 | (34.082,58) |
| (13) | NIKKEI 225 (OSE) 09/12/2021 | JPY | 2.961.723,37 | 43.010,39 |
| (14) | SPI 200 FUTURES 16/12/2021 | AUD | 1.590.952,47 | 22.768,55 |
| (373) | S&P500 EMINI FUTURE 17/12/2021 | USD | 69.160.047,89 | 2.249.343,43 |
| (19) | TOPIX INDEX FUTURE 09/12/2021 | JPY | 2.983.492,78 | 80.293,13 |
| | | | **113.783.653,07** | **3.204.416,77** |
| **Zins-Futures** | | | | |
| (175) | AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/12/2021 | AUD | 15.430.970,74 | 247.787,52 |
| (225) | CANADA 10YR BOND FUTURE 20/12/2021 | CAD | 21.937.340,10 | 415.468,37 |
| (46) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 6.206.780,00 | 38.180,00 |
| (522) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 88.646.040,00 | 1.299.039,13 |
| (150) | EURO-OAT FUTURE 08/12/2021 | EUR | 24.892.500,00 | 288.370,00 |
| (264) | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 38.439.054,37 | 954.186,70 |
| 20 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 3.297.165,54 | (141.968,04) |
| (431) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 48.943.992,95 | 475.576,15 |
| | | | **247.793.843,70** | **3.576.639,83** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR |
|---|---|---|---|
| **Bezugsrechte** | | | |
| 14.303 | VEOLIA ENVIRONNEMENT S.A. RIGHTS 01/10/2021 | EUR | 10.269,55 |
| 84 | HYUNDAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION CO LTD RIGHTS 22/10/2021 | KRW | 4.894,88 |
| | | | **15.164,43** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | **805.340,60** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **794.192.720,30** | **96,31** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **805.340,60** | **0,10** |
| **Bankguthaben** | **15.936.158,55** | **1,93** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **13.652.423,53** | **1,66** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **824.586.642,98** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 143.192.193,44 |
| | 30.09.2020 | EUR | 145.596.754,59 |
| | 30.09.2019 | EUR | 162.733.505,19 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.967,24 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.385,69 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.521,02 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 24.660,92 |
| | 30.09.2020 | PLN | 22.495,52 |
| | 30.09.2019 | PLN | 22.736,99 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.811,75 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.278,40 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.277,49 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 34,49 |
| | 30.09.2020 | EUR | 31,65 |
| | 30.09.2019 | EUR | 32,37 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 329,91 |
| | 30.09.2020 | EUR | 304,62 |
| | 30.09.2019 | EUR | 313,38 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 302,54 |
| | 30.09.2020 | EUR | 281,59 |
| | 30.09.2019 | EUR | 292,00 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.546,62 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.868,50 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.965,21 |
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 30.09.2021 | JPY | 9.989,00 |
| | 30.09.2020 | JPY | 9.320,00 |
| | 30.09.2019 | JPY | 9.702,00 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 1.992 |
| | 30.09.2020 | | 2.463 |
| | 30.09.2019 | | 4.446 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | | 202 |
| | 30.09.2020 | | 66 |
| | 30.09.2019 | | 978 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | | 0,51 |
| | 30.09.2020 | | 9 |
| | 30.09.2019 | | 9 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 9.487 |
| | 30.09.2020 | | 12.120 |
| | 30.09.2019 | | 21.817 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 198.816 |
| | 30.09.2020 | | 259.387 |
| | 30.09.2019 | | 308.582 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 934 |
| | 30.09.2020 | | 1.203 |
| | 30.09.2019 | | 3.084 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 7.390 |
| | 30.09.2020 | | 6.514 |
| | 30.09.2019 | | 4.181 |
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 30.09.2021 | | 80.995 |
| | 30.09.2020 | | 66.667 |
| | 30.09.2019 | | 14.364 |
| **Dividende** | | | |
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 31.08.2021 | JPY | 113,00 |
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 26.02.2021 | JPY | 107,00 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,76% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | | 0,79% |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | | 0,78% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 0,90% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 1,50% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 2,30% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,06% |
| Distribution I (HY) Hedged (i) (JPY) | 30.09.2021 | | 0,79% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 315,75% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **136.939.386,10** |
| Aktien | | 65.005.780,93 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 445.501,11 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | 758.114,12 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 70.729.989,94 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **719.971,50** |
| Futures | | 716.309,68 |
| Bezugsrechte | | 3.661,82 |
| **Bankguthaben** | | **4.067.436,59** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **743.333,40** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **3.569.813,50** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***146.039.941,09*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(1.896.630,79)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(951.116,86)** |
| Credit Default Swaps | | (281.935,83) |
| Devisentermingeschäfte | | (669.181,03) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(2.847.747,65)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***143.192.193,44*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **3.072.188,04** |
| Dividenden | | 1.244.552,32 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 1.759.433,76 |
| Zinsen auf Swaps | | 58.217,01 |
| Sonstige Erträge | 10 | 9.984,95 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.556.804,90)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.012.117,75) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (242.829,26) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (1.227,08) |
| Abonnementsteuer | 9 | (43.263,91) |
| Bankzinsen | | (41.337,73) |
| Zinsen auf Swaps | | (216.029,17) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **1.515.383,14** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 18.811.669,38 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (8.133.003,67) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 13.651.926,71 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (18.176.782,65) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 2.498.746,56 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (2.369.624,65) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 4.391.284,32 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 254.246,12 |
| **Ergebnis** | | **12.443.845,26** |
| Zeichnungen | | 19.183.006,22 |
| Rücknahmen | | (33.909.303,77) |
| Ausschüttung | | (122.108,86) |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 145.596.754,59 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***143.192.193,44*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

**Vereinigte Staaten**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1.246 | ABBVIE INC | USD | 115.972,23 | 0,08 |
| 589 | ADOBE INC | USD | 292.591,64 | 0,20 |
| 1.417 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | USD | 125.811,55 | 0,09 |
| 417 | AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC | USD | 92.150,54 | 0,06 |
| 1.023 | ALPHABET INC - C | USD | 2.352.657,26 | 1,64 |
| 588 | AMAZON.COM INC | USD | 1.666.684,08 | 1,16 |
| 775 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 176.619,35 | 0,12 |
| 639 | AMGEN INC | USD | 117.246,95 | 0,08 |
| 19.566 | APPLE INC | USD | 2.388.877,00 | 1,66 |
| 1.425 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 158.281,42 | 0,11 |
| 643 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 122.968,65 | 0,09 |
| 7.932 | BAKER HUGHES CO - A | USD | 169.255,24 | 0,11 |
| 11.676 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 427.668,32 | 0,29 |
| 65 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 133.139,09 | 0,09 |
| 1.639 | BROWN & BROWN INC | USD | 78.418,01 | 0,05 |
| 392 | BURLINGTON STORES INC | USD | 95.913,92 | 0,07 |
| 408 | CARMAX INC | USD | 45.047,40 | 0,03 |
| 1.061 | CATALENT INC | USD | 121.823,44 | 0,09 |
| 2.231 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 238.432,77 | 0,17 |
| 1.463 | CBRE GROUP INC - A | USD | 122.902,35 | 0,09 |
| 2.544 | CHENIERE ENERGY INC | USD | 214.394,48 | 0,15 |
| 4.097 | CHEVRON CORP | USD | 358.635,53 | 0,25 |
| 966 | CIGNA CORP | USD | 166.835,98 | 0,12 |
| 617 | CINTAS CORP | USD | 202.655,18 | 0,14 |
| 5.649 | CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE | USD | 265.304,86 | 0,19 |
| 1.338 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 87.256,60 | 0,06 |
| 7.449 | COMCAST CORP - A | USD | 359.482,78 | 0,25 |
| 1.311 | COPART INC | USD | 156.919,56 | 0,11 |
| 634 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 245.815,52 | 0,17 |
| 214 | CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | USD | 45.383,25 | 0,03 |
| 1.017 | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | USD | 152.091,50 | 0,11 |
| 5.268 | CSX CORP | USD | 135.182,98 | 0,09 |
| 894 | CUMMINS INC | USD | 173.222,87 | 0,12 |
| 750 | DANAHER CORP | USD | 197.014,54 | 0,14 |
| 357 | DEERE & CO | USD | 103.214,11 | 0,07 |
| 718 | DELL TECHNOLOGIES INC - C | USD | 64.455,52 | 0,05 |
| 234 | DOMINO'S PIZZA INC | USD | 96.301,51 | 0,07 |
| 2.419 | DOVER CORP | USD | 324.564,91 | 0,23 |
| 2.588 | EBAY INC | USD | 155.577,00 | 0,11 |
| 863 | ECOLAB INC | USD | 155.346,70 | 0,11 |
| 1.466 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 143.203,64 | 0,10 |
| 1.211 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 148.638,64 | 0,10 |
| 773 | ELI LILLY & CO | USD | 154.106,43 | 0,11 |
| 3.631 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 295.129,38 | 0,21 |
| 340 | EPAM SYSTEMS INC | USD | 167.361,15 | 0,12 |
| 647 | ESTEE LAUDER COS INC/THE - A | USD | 167.440,11 | 0,12 |
| 3.074 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 216.860,30 | 0,15 |
| 7.671 | FIFTH THIRD BANCORP | USD | 280.907,06 | 0,19 |
| 5.290 | FORD MOTOR CO | USD | 64.632,99 | 0,05 |
| 2.617 | FORTIVE CORP | USD | 159.352,60 | 0,11 |
| 715 | GARTNER INC | USD | 187.475,04 | 0,13 |
| 2.771 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 167.008,37 | 0,12 |
| 1.067 | HCA HEALTHCARE INC | USD | 223.462,82 | 0,16 |
| 1.365 | HERSHEY CO/THE | USD | 199.341,00 | 0,14 |
| 1.237 | HOME DEPOT INC/THE | USD | 350.366,81 | 0,24 |
| 2.947 | HP INC | USD | 69.571,53 | 0,05 |
| 287 | IDEXX LABORATORIES INC | USD | 154.006,04 | 0,11 |
| 236 | ILLUMINA INC | USD | 82.595,42 | 0,06 |
| 905 | INCYTE CORP | USD | 53.708,87 | 0,04 |
| 2.465 | INGERSOLL-RAND PLC | USD | 107.218,30 | 0,07 |
| 2.337 | INTEL CORP | USD | 107.438,08 | 0,08 |
| 432 | INTUIT INC | USD | 201.103,00 | 0,14 |
| 461 | INTUITIVE SURGICAL INC | USD | 395.446,87 | 0,28 |
| 269 | IQVIA HOLDINGS INC | USD | 55.598,83 | 0,04 |
| 3.606 | IRON MOUNTAIN INC | USD | 135.191,94 | 0,09 |
| 7.550 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 1.066.361,36 | 0,73 |
| 355 | KANSAS CITY SOUTHERN | USD | 82.900,21 | 0,06 |
| 2.700 | KEURIG DR PEPPER INC | USD | 79.582,38 | 0,06 |
| 3.360 | KROGER CO/THE | USD | 117.213,68 | 0,08 |
| 199 | LAM RESEARCH CORP | USD | 97.727,12 | 0,07 |
| 1.093 | LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | USD | 85.944,25 | 0,06 |
| 535 | LULULEMON ATHLETICA INC | USD | 186.819,53 | 0,13 |
| 729 | MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A | USD | 93.151,22 | 0,07 |
| 1.594 | MCDONALD'S CORP | USD | 331.618,57 | 0,23 |
| 86 | MERCADOLIBRE INC | USD | 124.620,04 | 0,09 |
| 3.542 | MERCK & CO INC | USD | 229.552,28 | 0,16 |
| 2.489 | METLIFE INC | USD | 132.573,42 | 0,09 |
| 10.585 | MICROSOFT CORP | USD | 2.574.850,68 | 1,79 |
| 549 | MOLINA HEALTHCARE INC | USD | 128.520,81 | 0,09 |
| 3.936 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A | USD | 197.589,61 | 0,14 |
| 1.246 | MONSTER BEVERAGE CORP | USD | 95.502,12 | 0,07 |
| 571 | MOODY'S CORP | USD | 174.958,20 | 0,12 |
| 7.028 | MORGAN STANLEY | USD | 590.098,52 | 0,41 |
| 1.713 | NASDAQ INC | USD | 285.295,53 | 0,20 |
| 2.369 | NETAPP INC | USD | 183.477,67 | 0,13 |
| 1.508 | NIKE INC - B | USD | 188.970,05 | 0,13 |
| 626 | NORFOLK SOUTHERN CORP | USD | 129.229,47 | 0,09 |
| 2.814 | NVIDIA CORP | USD | 502.996,89 | 0,35 |
| 3.262 | ONEOK INC | USD | 163.219,62 | 0,11 |
| 580 | ORACLE CORP | USD | 43.604,47 | 0,03 |
| 1.110 | PACKAGING CORP OF AMERICA | USD | 131.635,01 | 0,09 |
| 1.826 | PAYCHEX INC | USD | 177.172,18 | 0,12 |
| 1.663 | PAYPAL HOLDINGS INC | USD | 373.380,41 | 0,26 |
| 3.038 | PEPSICO INC | USD | 394.275,49 | 0,28 |
| 676 | PERKINELMER INC | USD | 101.077,73 | 0,07 |
| 6.729 | PFIZER INC | USD | 249.721,12 | 0,17 |
| 1.443 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 243.589,90 | 0,17 |
| 4.690 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | USD | 565.737,95 | 0,40 |
| 1.494 | PROLOGIS INC | USD | 161.691,55 | 0,11 |
| 1.883 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | USD | 170.923,34 | 0,12 |
| 280 | PTC INC | USD | 28.941,02 | 0,02 |
| 1.288 | PULTEGROUP INC | USD | 51.033,23 | 0,04 |
| 323 | REGENERON PHARMACEUTICALS INC | USD | 168.664,00 | 0,12 |
| 536 | RESMED INC | USD | 121.888,61 | 0,09 |
| 1.945 | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | USD | 168.378,14 | 0,12 |
| 214 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 54.294,46 | 0,04 |
| 144 | ROPER TECHNOLOGIES INC | USD | 55.431,83 | 0,04 |
| 1.366 | SALESFORCE.COM INC | USD | 319.674,29 | 0,22 |
| 609 | SERVICENOW INC | USD | 326.987,73 | 0,23 |
| 458 | SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | USD | 110.545,18 | 0,08 |
| 2.543 | SNAP INC - A | USD | 162.087,59 | 0,11 |
| 204 | SNAP-ON INC | USD | 36.779,67 | 0,03 |
| 2.889 | SOUTHWEST AIRLINES CO | USD | 128.203,35 | 0,09 |
| 660 | S&P GLOBAL INC | USD | 241.966,78 | 0,17 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 212 | SQUARE INC - A | USD | 43.872,54 | 0,03 |
| 726 | STANLEY BLACK & DECKER INC | USD | 109.819,28 | 0,08 |
| 1.431 | STARBUCKS CORP | USD | 136.203,99 | 0,10 |
| 1.944 | SYSCO CORP | USD | 131.674,36 | 0,09 |
| 1.150 | TARGET CORP | USD | 227.003,32 | 0,16 |
| 588 | TERADYNE INC | USD | 55.388,03 | 0,04 |
| 710 | TESLA INC | USD | 475.077,27 | 0,33 |
| 2.216 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 367.520,05 | 0,26 |
| 862 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 424.941,94 | 0,30 |
| 2.992 | TJX COS INC/THE | USD | 170.337,08 | 0,12 |
| 1.418 | T-MOBILE US INC | USD | 156.317,08 | 0,11 |
| 1.956 | TWITTER INC | USD | 101.922,29 | 0,07 |
| 108 | TYLER TECHNOLOGIES INC/THE | USD | 42.740,58 | 0,03 |
| 4.706 | UGI CORP | USD | 173.061,58 | 0,12 |
| 1.505 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 507.410,76 | 0,35 |
| 909 | UNITY SOFTWARE INC | USD | 99.021,74 | 0,07 |
| 7.473 | US BANCORP | USD | 383.273,76 | 0,26 |
| 3.988 | VENTAS INC | USD | 189.980,14 | 0,13 |
| 7.802 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 363.592,92 | 0,24 |
| 4.371 | VIACOMCBS INC - B | USD | 149.012,65 | 0,10 |
| 2.356 | VISA INC - A | USD | 452.822,81 | 0,32 |
| 832 | VORNADO REALTY TRUST | USD | 30.158,61 | 0,02 |
| 1.079 | VOYA FINANCIAL INC | USD | 57.155,02 | 0,04 |
| 2.222 | WALT DISNEY CO/THE | USD | 324.341,64 | 0,23 |
| 1.003 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 129.261,90 | 0,09 |
| 1.141 | WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP | USD | 84.874,77 | 0,06 |
| 1.479 | WEYERHAEUSER CO | USD | 45.392,84 | 0,03 |
| 707 | WHIRLPOOL CORP | USD | 124.361,72 | 0,09 |
| 954 | XILINX INC | USD | 124.288,76 | 0,09 |
| 1.590 | XYLEM INC/NY | USD | 169.680,49 | 0,12 |
| 373 | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A | USD | 165.884,34 | 0,12 |
| 1.166 | ZOETIS INC - A | USD | 195.320,97 | 0,14 |
| 625 | 3M CO | USD | 94.600,72 | 0,07 |
| | | | **35.726.056,02** | **24,95** |
| | **Japan** | | | |
| 4.100 | AEON MALL CO LTD | JPY | 54.531,38 | 0,04 |
| 1.700 | AISIN CORP | JPY | 53.347,85 | 0,04 |
| 5.300 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD | JPY | 221.528,12 | 0,15 |
| 12.055 | ASTELLAS PHARMA INC | JPY | 171.256,98 | 0,12 |
| 23.200 | CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD | JPY | 79.064,92 | 0,05 |
| 1.700 | DENSO CORP | JPY | 96.275,17 | 0,07 |
| 1.300 | EISAI CO LTD | JPY | 84.156,83 | 0,06 |
| 100 | FAST RETAILING CO LTD | JPY | 63.594,89 | 0,04 |
| 3.400 | HITACHI LTD | JPY | 174.068,65 | 0,12 |
| 6.360 | ITOCHU CORP | JPY | 160.696,76 | 0,11 |
| 6.200 | KAJIMA CORP | JPY | 68.933,53 | 0,05 |
| 2.200 | KDDI CORP | JPY | 62.609,51 | 0,04 |
| 21.600 | MARUBENI CORP | JPY | 155.418,26 | 0,11 |
| 700 | MEIJI HOLDINGS CO LTD | JPY | 38.914,09 | 0,03 |
| 5.600 | MINEBEA MITSUMI INC | JPY | 123.661,53 | 0,09 |
| 12.400 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS CORP | JPY | 97.855,02 | 0,07 |
| 41.400 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC | JPY | 210.007,01 | 0,14 |
| 3.700 | MITSUI CHEMICALS INC | JPY | 107.408,90 | 0,08 |
| 700 | NIPPON YUSEN KK | JPY | 45.606,67 | 0,03 |
| 6.800 | NOMURA RESEARCH INSTITUTE LTD | JPY | 217.061,51 | 0,15 |
| 2.000 | OMRON CORP | JPY | 171.169,57 | 0,12 |
| 40 | ORIX JREIT INC | JPY | 59.832,24 | 0,04 |
| 11.700 | PANASONIC CORP | JPY | 125.393,27 | 0,09 |
| 6.400 | SEKISUI CHEMICAL CO LTD | JPY | 95.090,09 | 0,07 |
| 1.200 | SHISEIDO CO LTD | JPY | 69.735,41 | 0,05 |
| 12.900 | SOFTBANK CORP | JPY | 150.637,31 | 0,11 |
| 4.100 | SOMPO HOLDINGS INC | JPY | 154.300,11 | 0,11 |
| 1.400 | SONY GROUP CORP | JPY | 134.445,21 | 0,09 |
| 5.200 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 148.306,86 | 0,10 |
| 543 | TOKYO ELECTRON LTD | JPY | 207.954,14 | 0,15 |
| 2.000 | TOYODA GOSEI CO LTD | JPY | 34.650,27 | 0,02 |
| 3.700 | TOYOTA TSUSHO CORP | JPY | 135.651,88 | 0,09 |
| 1.200 | YAMAHA CORP | JPY | 65.229,49 | 0,05 |
| 2.700 | YAMAHA MOTOR CO LTD | JPY | 64.951,91 | 0,05 |
| | | | **3.903.345,34** | **2,73** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 2.463 | ASHTEAD GROUP PLC | GBP | 161.786,84 | 0,11 |
| 2.415 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 251.690,09 | 0,18 |
| 27.600 | AVIVA PLC | GBP | 127.125,45 | 0,09 |
| 80.423 | BP PLC | GBP | 318.405,19 | 0,22 |
| 2.109 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | USD | 100.614,01 | 0,07 |
| 5.167 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 91.613,89 | 0,06 |
| 5.868 | DIAGEO PLC | GBP | 246.180,55 | 0,17 |
| 2.964 | HALMA PLC | GBP | 98.003,18 | 0,07 |
| 170.773 | LLOYDS BANKING GROUP PLC | GBP | 92.525,91 | 0,05 |
| 984 | NEXT PLC | GBP | 94.011,71 | 0,07 |
| 10.099 | RENTOKIL INITIAL PLC | GBP | 68.569,59 | 0,05 |
| 3.916 | SEGRO PLC | GBP | 54.443,81 | 0,04 |
| 2.369 | SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | USD | 111.852,69 | 0,08 |
| 2.748 | SMITH & NEPHEW PLC | GBP | 41.146,53 | 0,03 |
| 301 | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | GBP | 52.423,52 | 0,04 |
| 51.017 | TESCO PLC | GBP | 150.344,66 | 0,10 |
| 2.431 | UNILEVER PLC | GBP | 113.272,74 | 0,08 |
| 4.791 | UNITED UTILITIES GROUP PLC | GBP | 53.978,25 | 0,04 |
| 7.429 | 3I GROUP PLC | GBP | 110.761,01 | 0,08 |
| | | | **2.338.749,62** | **1,63** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 16.500 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD | HKD | 259.289,50 | 0,18 |
| 404 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR | USD | 51.608,96 | 0,04 |
| 5.000 | ANTA SPORTS PRODUCTS LTD | HKD | 81.114,30 | 0,06 |
| 12.000 | CHINA MEIDONG AUTO HOLDINGS LTD | HKD | 51.851,27 | 0,04 |
| 13.000 | CHINA MENGNIU DAIRY CO LTD | HKD | 72.046,96 | 0,05 |
| 22.000 | CK ASSET HOLDINGS LTD | HKD | 109.647,97 | 0,07 |
| 6.000 | COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS CO LTD | HKD | 40.778,17 | 0,03 |
| 2.800 | ENN ENERGY HOLDINGS LTD | HKD | 39.730,54 | 0,03 |
| 6.700 | JD.COM INC - A | HKD | 209.686,00 | 0,15 |
| 11.500 | LONGFOR GROUP HOLDINGS LTD | HKD | 45.624,03 | 0,03 |
| 4.114 | MEITUAN - B | HKD | 112.113,72 | 0,08 |
| 9.072 | NETEASE INC | HKD | 131.834,84 | 0,09 |
| 1.000 | SILERGY CORP | TWD | 126.754,89 | 0,09 |
| 3.800 | SUNNY OPTICAL TECHNOLOGY GROUP CO LTD | HKD | 86.003,26 | 0,06 |
| 8.000 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 407.914,33 | 0,28 |
| 24.000 | TINGYI CAYMAN ISLANDS HOLDING CORP | HKD | 38.404,42 | 0,02 |
| 18.000 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | HKD | 251.631,16 | 0,18 |
| | | | **2.116.034,32** | **1,48** |
| | **Kanada** | | | |
| 4.448 | BANK OF NOVA SCOTIA/THE | CAD | 236.181,95 | 0,16 |
| 3.417 | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | CAD | 328.151,35 | 0,23 |
| 1.994 | CCL INDUSTRIES INC - B | CAD | 89.092,08 | 0,06 |
| 3.530 | GILDAN ACTIVEWEAR INC - A | CAD | 111.270,02 | 0,08 |
| 9.821 | HYDRO ONE LTD | CAD | 200.270,79 | 0,14 |
| 2.872 | IGM FINANCIAL INC | CAD | 88.514,23 | 0,06 |
| 4.707 | KEYERA CORP | CAD | 102.173,05 | 0,07 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 4.563 | LUNDIN MINING CORP | CAD | 28.312,55 | 0,02 |
| 2.496 | MANULIFE FINANCIAL CORP | CAD | 41.446,55 | 0,03 |
| 1.082 | METRO INC | CAD | 45.609,77 | 0,03 |
| 192 | SHOPIFY INC - A | CAD | 224.824,06 | 0,16 |
| 6.762 | SUN LIFE FINANCIAL INC | CAD | 300.284,46 | 0,21 |
| 7.342 | TELUS CORP | CAD | 139.217,46 | 0,10 |
| 1.208 | THOMSON REUTERS CORP | CAD | 115.228,56 | 0,08 |
| 476 | TMX GROUP LTD | CAD | 44.282,89 | 0,03 |
| | | | **2.094.859,77** | **1,46** |
| | **Schweiz** | | | |
| 55 | EMS-CHEMIE HOLDING AG - REG | CHF | 44.971,61 | 0,03 |
| 937 | GARMIN LTD | USD | 125.687,92 | 0,09 |
| 217 | GEBERIT AG - REG | CHF | 138.293,71 | 0,10 |
| 11 | GIVAUDAN SA - REG | CHF | 43.364,03 | 0,03 |
| 4.790 | NESTLE SA - REG | CHF | 499.324,53 | 0,35 |
| 160 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 217.032,88 | 0,15 |
| 517 | ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN | CHF | 163.522,16 | 0,11 |
| 562 | SIKA AG - REG | CHF | 154.284,99 | 0,11 |
| 488 | SONOVA HOLDING AG - REG | CHF | 160.330,54 | 0,11 |
| 1.165 | SWISS PRIME SITE AG - REG | CHF | 98.490,78 | 0,07 |
| 282 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 140.174,90 | 0,10 |
| 1.127 | TE CONNECTIVITY LTD | USD | 133.437,11 | 0,09 |
| 12.425 | UBS GROUP AG - REG | CHF | 172.389,63 | 0,12 |
| | | | **2.091.304,79** | **1,46** |
| | **Frankreich** | | | |
| 3.193 | AXA SA | EUR | 76.903,41 | 0,05 |
| 900 | CAPGEMINI SE | EUR | 162.135,00 | 0,11 |
| 875 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA | EUR | 116.200,00 | 0,08 |
| 2.512 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 146.298,88 | 0,10 |
| 7.193 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 85.927,58 | 0,06 |
| 406 | EDENRED | EUR | 18.931,78 | 0,01 |
| 128 | HERMES INTERNATIONAL | EUR | 153.152,00 | 0,11 |
| 1.303 | LEGRAND SA | EUR | 120.866,28 | 0,08 |
| 778 | L'OREAL SA | EUR | 277.629,30 | 0,19 |
| 651 | PERNOD RICARD SA | EUR | 124.145,70 | 0,09 |
| 390 | TELEPERFORMANCE | EUR | 132.639,00 | 0,09 |
| 9.289 | TOTALENERGIES SE | EUR | 383.960,82 | 0,28 |
| 3.558 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA | EUR | 94.144,68 | 0,07 |
| 4.882 | VIVENDI SE | EUR | 53.238,21 | 0,04 |
| | | | **1.946.172,64** | **1,36** |
| | **Irland** | | | |
| 1.313 | ACCENTURE PLC - A | USD | 362.444,42 | 0,25 |
| 625 | AON PLC - A | USD | 154.110,40 | 0,11 |
| 2.354 | CRH PLC | EUR | 95.478,24 | 0,07 |
| 630 | HORIZON THERAPEUTICS PLC | USD | 59.545,45 | 0,04 |
| 819 | LINDE PLC | USD | 207.324,06 | 0,14 |
| 4.029 | MEDTRONIC PLC | USD | 435.769,58 | 0,30 |
| 2.160 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 98.020,80 | 0,07 |
| 955 | STERIS PLC | USD | 168.331,16 | 0,12 |
| | | | **1.581.024,11** | **1,10** |
| | **Deutschland** | | | |
| 487 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 94.887,08 | 0,07 |
| 6.051 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 329.658,48 | 0,22 |
| 5.018 | EVONIK INDUSTRIES AG | EUR | 136.840,86 | 0,10 |
| 613 | MERCK KGAA | EUR | 115.029,45 | 0,08 |
| 245 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 58.040,50 | 0,04 |
| 1.194 | NEMETSCHEK SE | EUR | 108.295,80 | 0,08 |
| 1.954 | SIEMENS AG - REG | EUR | 277.311,68 | 0,19 |
| 2.452 | SIEMENS HEALTHINEERS AG | EUR | 137.753,36 | 0,10 |
| 16.079 | TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDING AG | EUR | 39.522,18 | 0,02 |
| 1.619 | VONOVIA SE | EUR | 84.026,10 | 0,06 |
| 865 | ZALANDO SE | EUR | 68.611,80 | 0,05 |
| | | | **1.449.977,29** | **1,01** |
| | **Taiwan** | | | |
| 2.000 | ACCTON TECHNOLOGY CORP | TWD | 16.241,92 | 0,01 |
| 4.642 | ADVANTECH CO LTD | TWD | 52.317,81 | 0,04 |
| 112.988 | CTBC FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 79.894,96 | 0,06 |
| 7.000 | DELTA ELECTRONICS INC | TWD | 54.469,09 | 0,04 |
| 3.000 | ECLAT TEXTILE CO LTD | TWD | 56.229,15 | 0,04 |
| 7.000 | MEDIATEK INC | TWD | 195.613,21 | 0,14 |
| 44.310 | MEGA FINANCIAL HOLDING CO LTD | TWD | 43.851,19 | 0,03 |
| 29.000 | TAIWAN MOBILE CO LTD | TWD | 88.561,68 | 0,06 |
| 33.877 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 606.714,68 | 0,42 |
| 46.832 | UNITED MICROELECTRONICS CORP | TWD | 92.549,54 | 0,06 |
| 2.000 | WIWYNN CORP | TWD | 53.728,02 | 0,04 |
| | | | **1.340.171,25** | **0,94** |
| | **Niederlande** | | | |
| 69 | ADYEN NV | EUR | 166.635,00 | 0,12 |
| 418 | AKZO NOBEL NV | EUR | 39.450,84 | 0,03 |
| 525 | ASML HOLDING NV | EUR | 339.097,50 | 0,24 |
| 941 | KONINKLIJKE PHILIPS NV | EUR | 36.077,94 | 0,03 |
| 1.967 | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A | USD | 159.284,65 | 0,11 |
| 1.380 | PROSUS NV | EUR | 95.206,20 | 0,07 |
| 10.084 | STELLANTIS NV | EUR | 167.152,38 | 0,11 |
| 4.882 | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | EUR | 112.847,43 | 0,07 |
| 1.616 | WOLTERS KLUWER NV | EUR | 147.993,28 | 0,10 |
| | | | **1.263.745,22** | **0,88** |
| | **Australien** | | | |
| 5.598 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD | AUD | 97.926,31 | 0,07 |
| 6.427 | BRAMBLES LTD | AUD | 43.014,23 | 0,03 |
| 600 | COCHLEAR LTD | AUD | 82.177,13 | 0,06 |
| 9.156 | COMPUTERSHARE LTD | AUD | 103.667,42 | 0,06 |
| 857 | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD | AUD | 85.454,66 | 0,06 |
| 3.929 | FORTESCUE METALS GROUP LTD | AUD | 36.525,97 | 0,03 |
| 7.236 | GOODMAN GROUP | AUD | 97.486,83 | 0,07 |
| 1.299 | MACQUARIE GROUP LTD | AUD | 146.915,85 | 0,10 |
| 1.149 | REA GROUP LTD | AUD | 113.421,49 | 0,08 |
| 4.456 | SONIC HEALTHCARE LTD | AUD | 112.590,22 | 0,08 |
| 3.666 | WESFARMERS LTD | AUD | 127.006,35 | 0,09 |
| 2.350 | WOOLWORTHS GROUP LTD | AUD | 57.464,64 | 0,04 |
| | | | **1.103.651,10** | **0,77** |
| | **Südkorea** | | | |
| 182 | CJ CHEILJEDANG CORP | KRW | 54.151,94 | 0,04 |
| 2.923 | HANA FINANCIAL GROUP INC | KRW | 98.545,21 | 0,07 |
| 1.105 | HYUNDAI ENGINEERING & CONSTRUCTION CO LTD | KRW | 41.268,07 | 0,03 |
| 2.060 | HYUNDAI STEEL CO | KRW | 70.872,20 | 0,05 |
| 80 | LG CHEM LTD | KRW | 45.106,64 | 0,03 |
| 354 | NAVER CORP | KRW | 99.798,43 | 0,07 |
| 3.617 | SAMSUNG ENGINEERING CO LTD | KRW | 67.147,24 | 0,04 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 440 | SAMSUNG FIRE & MARINE INSURANCE CO LTD | KRW | 75.129,29 | 0,05 |
| 233 | SAMSUNG SDS CO LTD | KRW | 27.171,88 | 0,02 |
| 3.153 | SHINHAN FINANCIAL GROUP CO LTD | KRW | 92.553,76 | 0,06 |
| 687 | SK HYNIX INC | KRW | 51.414,15 | 0,04 |
| 486 | SK INNOVATION CO LTD | KRW | 93.577,38 | 0,07 |
| 460 | SK TELECOM CO LTD | KRW | 108.290,80 | 0,08 |
| | | | **925.026,99** | **0,65** |
| | **Bermuda** | | | |
| 2.326 | ATHENE HOLDING LTD - A | USD | 138.221,34 | 0,10 |
| 5.130 | AXALTA COATING SYSTEMS LTD | USD | 129.207,21 | 0,09 |
| 118.000 | BRILLIANCE CHINA AUTOMOTIVE HOLDINGS LTD | HKD | 95.193,27 | 0,06 |
| 8.000 | CHINA RESOURCES GAS GROUP LTD | HKD | 36.158,86 | 0,03 |
| 2.746 | IHS MARKIT LTD | USD | 276.317,80 | 0,19 |
| | | | **675.098,48** | **0,47** |
| | **China** | | | |
| 532.600 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA LTD -H | HKD | 157.738,39 | 0,11 |
| 80.000 | ALUMINUM CORP OF CHINA LTD - H | HKD | 52.072,28 | 0,04 |
| 164.400 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP - H | HKD | 101.376,52 | 0,07 |
| 3.400 | GANFENG LITHIUM CO LTD - H | HKD | 52.001,56 | 0,04 |
| 159.000 | PEOPLE'S INSURANCE CO GROUP - H | HKD | 42.522,02 | 0,03 |
| 100.000 | PICC PROPERTY & CASUALTY CO LTD - H | HKD | 83.435,02 | 0,06 |
| 90.000 | ZHEJIANG EXPRESSWAY CO LTD - H | HKD | 63.852,65 | 0,04 |
| | | | **552.998,44** | **0,39** |
| | **Österreich** | | | |
| 2.832 | OMV AG | EUR | 147.773,76 | 0,10 |
| 2.727 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG | EUR | 61.848,36 | 0,04 |
| 2.173 | VERBUND AG | EUR | 190.572,10 | 0,13 |
| 1.673 | VOESTALPINE AG | EUR | 53.602,92 | 0,04 |
| | | | **453.797,14** | **0,31** |
| | **Italien** | | | |
| 3.588 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA | EUR | 65.983,32 | 0,05 |
| 6.840 | FINECOBANK BANCA FINECO SPA | EUR | 107.182,80 | 0,07 |
| 2.058 | RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA E FARMACEUTICA SPA | EUR | 103.476,24 | 0,07 |
| 20.872 | SNAM SPA | EUR | 100.102,11 | 0,07 |
| 4.742 | UNICREDIT SPA | EUR | 54.533,00 | 0,04 |
| | | | **431.277,47** | **0,30** |
| | **Schweden** | | | |
| 3.635 | ATLAS COPCO AB - A | SEK | 190.800,06 | 0,13 |
| 978 | BOLIDEN AB | SEK | 27.230,08 | 0,02 |
| 13.533 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB - A | SEK | 165.373,00 | 0,12 |
| 2.087 | SVENSKA CELLULOSA AB SCA -B | SEK | 28.076,05 | 0,02 |
| | | | **411.479,19** | **0,29** |
| | **Hongkong** | | | |
| 3.200 | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | HKD | 169.672,56 | 0,12 |
| 88.000 | PCCW LTD | HKD | 38.899,50 | 0,03 |
| 9.000 | SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD | HKD | 96.873,02 | 0,07 |
| 6.000 | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | HKD | 102.840,56 | 0,07 |
| | | | **408.285,64** | **0,29** |
| | **Spanien** | | | |
| 295 | AENA SME SA | EUR | 44.043,50 | 0,03 |
| 689 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 39.190,32 | 0,03 |
| 5.445 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 173.259,90 | 0,12 |
| 6.494 | NATURGY ENERGY GROUP SA | EUR | 141.244,50 | 0,10 |
| | | | **397.738,22** | **0,28** |
| | **Russland** | | | |
| 37.424 | ALROSA PJSC | RUB | 59.014,75 | 0,04 |
| 4.332 | MOBILE TELESYSTEMS PJSC ADR | USD | 36.033,03 | 0,03 |
| 55.304 | MOSCOW EXCHANGE MICEX-RTS PJSC | RUB | 114.031,39 | 0,07 |
| 45.324 | SBERBANK OF RUSSIA PJSC | RUB | 183.113,86 | 0,13 |
| | | | **392.193,03** | **0,27** |
| | **Dänemark** | | | |
| 4.523 | NOVO NORDISK AS - B | DKK | 377.974,07 | 0,26 |
| | | | **377.974,07** | **0,26** |
| | **Südafrika** | | | |
| 3.237 | BID CORP LTD | ZAR | 59.891,28 | 0,04 |
| 6.500 | BIDVEST GROUP LTD/THE | ZAR | 73.065,53 | 0,06 |
| 2.749 | CLICKS GROUP LTD | ZAR | 43.781,81 | 0,03 |
| 2.155 | IMPALA PLATINUM HOLDINGS LTD | ZAR | 21.217,04 | 0,01 |
| 5.983 | STANDARD BANK GROUP LTD | ZAR | 49.129,74 | 0,03 |
| 7.661 | VODACOM GROUP LTD | ZAR | 63.286,59 | 0,05 |
| | | | **310.371,99** | **0,22** |
| | **Brasilien** | | | |
| 9.153 | BANCO SANTANDER BRASIL SA | BRL | 51.265,47 | 0,04 |
| 13.156 | CPFL ENERGIA SA | BRL | 56.103,08 | 0,04 |
| 8.127 | HYPERA SA | BRL | 41.362,10 | 0,03 |
| 9.760 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA - PREF | BRL | 44.712,06 | 0,03 |
| 4.331 | LOCALIZA RENT A CAR SA | BRL | 37.357,00 | 0,03 |
| 13.285 | RUMO SA | BRL | 35.321,47 | 0,02 |
| | | | **266.121,18** | **0,19** |
| | **Mexiko** | | | |
| 12.355 | FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV | MXN | 92.919,17 | 0,06 |
| 13.613 | GRUPO FINANCIERO BANORTE SAB DE CV | MXN | 75.634,61 | 0,05 |
| 29.790 | WAL-MART DE MEXICO SAB DE CV | MXN | 87.518,11 | 0,07 |
| | | | **256.071,89** | **0,18** |
| | **Singapur** | | | |
| 13.900 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD | SGD | 101.293,43 | 0,07 |
| 8.500 | UNITED OVERSEAS BANK LTD | SGD | 139.234,90 | 0,10 |
| | | | **240.528,33** | **0,17** |
| | **Jersey** | | | |
| 1.058 | APTIV PLC | USD | 135.994,01 | 0,09 |
| 8.384 | WPP PLC | GBP | 97.590,22 | 0,07 |
| | | | **233.584,23** | **0,16** |
| | **Norwegen** | | | |
| 35.008 | NORSK HYDRO ASA | NOK | 226.725,07 | 0,16 |
| | | | **226.725,07** | **0,16** |
| | **Belgien** | | | |
| 699 | AGEAS SA/NV | EUR | 29.931,18 | 0,02 |
| 1.949 | KBC GROUP NV | EUR | 152.099,96 | 0,11 |
| | | | **182.031,14** | **0,13** |
| | **Curacao** | | | |
| 7.018 | SCHLUMBERGER NV | USD | 179.484,46 | 0,13 |
| | | | **179.484,46** | **0,13** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Neuseeland** | | | |
| 19.094 | MERIDIAN ENERGY LTD | NZD | 55.864,87 | 0,04 |
| 35.562 | SPARK NEW ZEALAND LTD | NZD | 100.880,93 | 0,07 |
| | | | **156.745,80** | **0,11** |
| | **Israel** | | | |
| 12.323 | BANK HAPOALIM BM | ILS | 93.931,67 | 0,07 |
| 289 | WIX.COM LTD | USD | 48.867,79 | 0,03 |
| | | | **142.799,46** | **0,10** |
| | **Indonesien** | | | |
| 31.500 | BANK CENTRAL ASIA TBK PT | IDR | 66.267,95 | 0,05 |
| 291.200 | TELKOM INDONESIA PERSERO TBK PT | IDR | 64.586,64 | 0,04 |
| | | | **130.854,59** | **0,09** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 535 | GLOBANT SA | USD | 129.721,17 | 0,09 |
| | | | **129.721,17** | **0,09** |
| | **Thailand** | | | |
| 37.700 | ENERGY ABSOLUTE PCL | THB | 58.711,31 | 0,04 |
| 84.000 | MINOR INTERNATIONAL PCL | THB | 67.276,62 | 0,05 |
| | | | **125.987,93** | **0,09** |
| | **Finnland** | | | |
| 2.324 | NESTE OYJ | EUR | 113.806,28 | 0,08 |
| | | | **113.806,28** | **0,08** |
| | **Philippinen** | | | |
| 31.110 | INTERNATIONAL CONTAINER TERMINAL SERVICES INC | PHP | 102.310,40 | 0,07 |
| | | | **102.310,40** | **0,07** |
| | **Malaysia** | | | |
| 900 | NESTLE MALAYSIA BHD | MYR | 24.615,57 | 0,02 |
| 90.800 | PUBLIC BANK BHD | MYR | 75.939,84 | 0,05 |
| | | | **100.555,41** | **0,07** |
| | **Chile** | | | |
| 482.922 | BANCO SANTANDER CHILE | CLP | 20.844,72 | 0,01 |
| 5.787 | EMPRESAS COPEC SA | CLP | 41.375,27 | 0,03 |
| | | | **62.219,99** | **0,04** |
| | **Ungarn** | | | |
| 700 | OTP BANK NYRT | HUF | 35.466,22 | 0,02 |
| | | | **35.466,22** | **0,02** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 8.453 | MONETA MONEY BANK AS | CZK | 29.435,25 | 0,02 |
| | | | **29.435,25** | **0,02** |
| | | | **65.005.780,93** | **45,40** |
| | **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 600.000 | ABBVIE INC 4.050% 21/11/2039 | USD | 594.697,99 | 0,42 |
| 81.000 | AETHON UNITED BR LP / AETHON UNITED FINANCE CORP 8.250% 15/02/2026 | USD | 75.478,13 | 0,05 |
| 292.000 | AMERICAN AIRLINES INC 11.750% 15/07/2025 | USD | 311.676,58 | 0,22 |
| 600.000 | AMERICAN TOWER CORP 3.950% 15/03/2029 | USD | 576.495,35 | 0,40 |
| 200.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 01/03/2027 | USD | 178.363,08 | 0,12 |
| 95.000 | ANTERO RESOURCES CORP 7.625% 01/02/2029 | USD | 91.599,28 | 0,06 |
| 100.000 | APEX TOOL GROUP LLC / BC MOUNTAIN FINANCE INC 9.000% 15/02/2023 | USD | 86.494,55 | 0,06 |
| 125.000 | ARCHES BUYER INC 6.125% 01/12/2028 | USD | 109.914,32 | 0,08 |
| 130.000 | ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.250% 01/04/2028 | USD | 115.866,31 | 0,08 |
| 800.000 | AT&T INC 4.850% 01/03/2039 | USD | 827.166,46 | 0,58 |
| 81.000 | AUDACY CAPITAL CORP 6.750% 31/03/2029 | USD | 70.462,54 | 0,05 |
| 500.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/10/2030 FRN | USD | 450.378,95 | 0,31 |
| 500.000 | BANK OF AMERICA CORP 29/04/2031 FRN | USD | 440.070,25 | 0,31 |
| 100.000 | BAUSCH HEALTH AMERICAS INC 8.500% 31/01/2027 | USD | 92.033,19 | 0,06 |
| 200.000 | BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026 | USD | 179.904,91 | 0,13 |
| 20.000 | BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 7.625% 15/12/2025 | USD | 18.655,18 | 0,01 |
| 600.000 | BOOKING HOLDINGS INC 4.625% 13/04/2030 | USD | 615.684,90 | 0,43 |
| 250.000 | BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 4.050% 01/07/2030 | USD | 240.228,28 | 0,17 |
| 700.000 | BROADCOM INC 5.000% 15/04/2030 | USD | 705.802,09 | 0,49 |
| 1.100.000 | BROWN & BROWN INC 2.375% 15/03/2031 | USD | 946.012,75 | 0,66 |
| 138.000 | BUILDERS FIRSTSOURCE INC 4.250% 01/02/2032 | USD | 121.808,73 | 0,09 |
| 163.000 | CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC 4.750% 01/02/2028 | USD | 145.407,48 | 0,10 |
| 126.000 | CARRIAGE SERVICES INC 4.250% 15/05/2029 | USD | 109.723,34 | 0,08 |
| 480.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.750% 01/03/2030 | USD | 432.952,18 | 0,30 |
| 36.000 | CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028 | USD | 31.212,74 | 0,02 |
| 155.000 | CENTENE CORP 2.500% 01/03/2031 | USD | 131.815,98 | 0,09 |
| 70.000 | CENTENE CORP 3.375% 15/02/2030 | USD | 62.516,13 | 0,04 |
| 250.000 | CENTENE CORP 4.625% 15/12/2029 | USD | 234.956,06 | 0,16 |
| 900.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 4.800% 01/03/2050 | USD | 874.744,33 | 0,61 |
| 200.000 | CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026 | EUR | 204.000,00 | 0,14 |
| 35.000 | CHEMOURS CO/THE 4.625% 15/11/2029 | USD | 29.495,05 | 0,02 |
| 200.000 | CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.500% 01/10/2029 | USD | 183.579,90 | 0,13 |
| 600.000 | CITIGROUP INC 20/03/2030 FRN | USD | 582.025,20 | 0,41 |
| 400.000 | CITIGROUP INC 31/03/2031 FRN | USD | 398.388,14 | 0,28 |
| 114.000 | CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 3.875% 01/07/2028 | USD | 98.380,03 | 0,07 |
| 105.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 3.750% 15/02/2031 | USD | 91.369,39 | 0,06 |
| 125.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 4.750% 15/03/2028 | USD | 114.113,39 | 0,08 |
| 126.000 | CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875% 01/03/2031 | USD | 112.260,04 | 0,08 |
| 92.000 | CNX MIDSTREAM PARTNERS LP / CNX MIDSTREAM FINANCE CORP 6.500% 15/03/2026 | USD | 83.380,78 | 0,06 |
| 73.000 | CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 5.000% 01/10/2028 | USD | 65.009,35 | 0,05 |
| 104.000 | CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 6.500% 01/10/2028 | USD | 97.824,76 | 0,07 |
| 150.000 | COTY INC 4.000% 15/04/2023 | EUR | 151.238,70 | 0,11 |
| 350.000 | CSC HOLDINGS LLC 5.375% 01/02/2028 | USD | 315.510,51 | 0,22 |
| 500.000 | CVS HEALTH CORP 1.300% 21/08/2027 | USD | 424.638,76 | 0,30 |
| 1.000.000 | DAE FUNDING LLC 3.375% 20/03/2028 | USD | 890.024,84 | 0,62 |
| 500.000 | DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.300% 01/10/2029 | USD | 521.706,02 | 0,36 |
| 500.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 3.125% 24/03/2031 | USD | 447.338,65 | 0,31 |
| 136.000 | ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.750% 30/01/2028 | USD | 123.557,51 | 0,09 |
| 150.000 | ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.850% 15/07/2026 | USD | 135.831,61 | 0,09 |
| 19.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.500% 15/01/2029 | USD | 17.029,40 | 0,01 |
| 19.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.750% 15/01/2031 | USD | 17.050,09 | 0,01 |
| 200.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 5.500% 15/07/2028 | USD | 189.812,58 | 0,13 |
| 150.000 | FORD MOTOR CO 9.000% 22/04/2025 | USD | 155.670,93 | 0,11 |
| 225.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.000% 13/11/2030 | USD | 201.886,77 | 0,14 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 200.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.542% 01/08/2026 | USD | 185.877,64 | 0,13 |
| 500.000 | GENERAL MOTORS CO 5.000% 01/04/2035 | USD | 510.214,34 | 0,36 |
| 300.000 | GENERAL MOTORS CO 6.800% 01/10/2027 | USD | 323.339,47 | 0,23 |
| 600.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 27/01/2032 FRN | USD | 498.757,38 | 0,35 |
| 40.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.375% 15/06/2026 | USD | 35.023,66 | 0,02 |
| 175.000 | HB FULLER CO 4.250% 15/10/2028 | USD | 153.596,63 | 0,11 |
| 355.000 | HCA INC 3.500% 01/09/2030 | USD | 324.484,55 | 0,23 |
| 200.000 | HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 196.331,95 | 0,14 |
| 200.000 | IHEARTCOMMUNICATIONS INC 5.250% 15/08/2027 | USD | 179.469,09 | 0,13 |
| 73.000 | INGLES MARKETS INC 4.000% 15/06/2031 | USD | 63.895,63 | 0,04 |
| 200.000 | IQVIA INC 2.250% 15/01/2028 | EUR | 201.212,39 | 0,14 |
| 200.000 | JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO-ISSUER CORP 5.000% 15/08/2028 | USD | 175.008,41 | 0,12 |
| 1.000.000 | JPMORGAN CHASE & CO 13/05/2031 FRN | USD | 898.499,50 | 0,63 |
| 131.000 | KB HOME 4.000% 15/06/2031 | USD | 115.979,15 | 0,08 |
| 125.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 3.875% 15/05/2027 | USD | 117.674,64 | 0,08 |
| 250.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 4.375% 01/06/2046 | USD | 246.126,24 | 0,17 |
| 125.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 4.625% 30/01/2029 | USD | 123.179,27 | 0,09 |
| 221.000 | KRATON POLYMERS LLC / KRATON POLYMERS CAPITAL CORP 4.250% 15/12/2025 | USD | 198.861,85 | 0,14 |
| 175.000 | LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLP / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 5.250% 01/10/2025 | USD | 152.962,90 | 0,11 |
| 150.000 | LAREDO PETROLEUM INC 7.750% 31/07/2029 | USD | 129.675,19 | 0,09 |
| 175.000 | LOGMEIN INC 5.500% 01/09/2027 | USD | 153.341,93 | 0,11 |
| 103.000 | LPL HOLDINGS INC 4.000% 15/03/2029 | USD | 91.327,38 | 0,06 |
| 800.000 | MASCO CORP 2.000% 01/10/2030 | USD | 667.554,77 | 0,47 |
| 175.000 | MATADOR RESOURCES CO 5.875% 15/09/2026 | USD | 155.797,77 | 0,11 |
| 126.000 | MATTEL INC 3.750% 01/04/2029 | USD | 113.346,23 | 0,08 |
| 9.000 | MATTEL INC 6.200% 01/10/2040 | USD | 9.984,56 | 0,01 |
| 73.000 | MAV ACQUISITION CORP 5.750% 01/08/2028 | USD | 61.837,02 | 0,04 |
| 100.000 | MEDNAX INC 6.250% 15/01/2027 | USD | 90.747,79 | 0,06 |
| 200.000 | MGM GROWTH PROPERTIES OPERATING PARTNERSHIP LP / MGP FINANCE CO-ISSUER INC 5.750% 01/02/2027 | USD | 198.352,03 | 0,14 |
| 200.000 | MGM RESORTS INTERNATIONAL 5.500% 15/04/2027 | USD | 187.703,41 | 0,13 |
| 87.000 | MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 77.257,87 | 0,05 |
| 100.000 | MOHEGAN GAMING & ENTERTAINMENT 8.000% 01/02/2026 | USD | 90.076,07 | 0,06 |
| 500.000 | MORGAN STANLEY 22/07/2028 FRN | USD | 473.973,24 | 0,33 |
| 250.000 | MPLX LP 4.700% 15/04/2048 | USD | 248.593,41 | 0,17 |
| 150.000 | NETFLIX INC 3.625% 15/06/2030 | EUR | 179.642,28 | 0,13 |
| 150.000 | NFP CORP 6.875% 15/08/2028 | USD | 132.100,17 | 0,09 |
| 170.000 | NUSTAR LOGISTICS LP 6.000% 01/06/2026 | USD | 159.131,46 | 0,11 |
| 100.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.400% 15/04/2026 | USD | 88.570,47 | 0,06 |
| 75.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.500% 15/07/2027 | USD | 81.057,91 | 0,06 |
| 75.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.875% 15/07/2030 | USD | 87.915,63 | 0,06 |
| 200.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 7.125% 15/03/2026 | USD | 199.577,54 | 0,14 |
| 200.000 | OWENS-BROCKWAY GLASS CONTAINER INC 6.625% 13/05/2027 | USD | 185.361,02 | 0,13 |
| 125.000 | PITNEY BOWES INC 6.875% 15/03/2027 | USD | 113.859,98 | 0,08 |
| 100.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 3.550% 15/12/2029 | USD | 90.748,85 | 0,06 |
| 400.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.900% 15/02/2045 | USD | 374.646,06 | 0,26 |
| 225.000 | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 3.375% 31/08/2027 | USD | 186.417,77 | 0,13 |
| 125.000 | PRIMO WATER HOLDINGS INC 3.875% 31/10/2028 | EUR | 129.587,57 | 0,09 |
| 53.000 | PRIMO WATER HOLDINGS INC 4.375% 30/04/2029 | USD | 45.509,68 | 0,03 |
| 125.000 | RADIAN GROUP INC 4.875% 15/03/2027 | USD | 117.665,21 | 0,08 |
| 120.000 | RAIN CII CARBON LLC / CII CARBON CORP 7.250% 01/04/2025 | USD | 106.263,82 | 0,07 |
| 116.000 | RANGE RESOURCES CORP 8.250% 15/01/2029 | USD | 112.600,64 | 0,08 |
| 92.000 | REAL HERO MERGER SUB 2 INC 6.250% 01/02/2029 | USD | 82.344,51 | 0,06 |
| 150.000 | ROCKET SOFTWARE INC 6.500% 15/02/2029 | USD | 128.011,81 | 0,09 |
| 19.000 | SCRIPPS ESCROW II INC 3.875% 15/01/2029 | USD | 16.447,30 | 0,01 |
| 50.000 | SENSATA TECHNOLOGIES INC 3.750% 15/02/2031 | USD | 43.425,91 | 0,03 |
| 150.000 | SENSATA TECHNOLOGIES INC 4.375% 15/02/2030 | USD | 139.202,30 | 0,10 |
| 100.000 | SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.000% 15/05/2031 | USD | 89.251,94 | 0,06 |
| 50.000 | SIRIUS XM RADIO INC 3.125% 01/09/2026 | USD | 43.728,73 | 0,03 |
| 300.000 | SPRINT CAPITAL CORP 6.875% 15/11/2028 | USD | 330.617,13 | 0,23 |
| 200.000 | STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 4.750% 15/01/2028 | USD | 179.808,40 | 0,13 |
| 75.000 | STAPLES INC 10.750% 15/04/2027 | USD | 62.965,09 | 0,04 |
| 200.000 | STAPLES INC 7.500% 15/04/2026 | USD | 175.008,91 | 0,12 |
| 17.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 3.625% 15/07/2026 | USD | 14.774,24 | 0,01 |
| 175.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 5.500% 01/11/2023 | USD | 158.526,38 | 0,11 |
| 102.000 | SUNCOKE ENERGY INC 4.875% 30/06/2029 | USD | 87.662,30 | 0,06 |
| 31.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.000% 15/01/2032 | USD | 27.637,02 | 0,02 |
| 100.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.375% 01/02/2027 | USD | 89.330,22 | 0,06 |
| 300.000 | TENET HEALTHCARE CORP 5.125% 01/11/2027 | USD | 270.616,79 | 0,19 |
| 60.000 | T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029 | USD | 52.293,24 | 0,04 |
| 226.000 | T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031 | USD | 196.750,89 | 0,14 |
| 1.100.000 | T-MOBILE USA INC 3.000% 15/02/2041 | USD | 920.300,53 | 0,64 |
| 200.000 | T-MOBILE USA INC 4.750% 01/02/2028 | USD | 183.214,11 | 0,13 |
| 113.000 | TTM TECHNOLOGIES INC 4.000% 01/03/2029 | USD | 97.083,16 | 0,07 |
| 200.000 | UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.875% 15/11/2027 | USD | 180.856,39 | 0,13 |
| 450.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE 0.875% 15/11/2030 | USD | 368.625,70 | 0,26 |
| 1.010.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE 1.500% 15/02/2030 | USD | 877.333,74 | 0,61 |
| 1.135.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.250% 15/05/2041 | USD | 1.018.661,15 | 0,72 |
| 170.000 | UNIVISION COMMUNICATIONS INC 4.500% 01/05/2029 | USD | 149.366,85 | 0,10 |
| 350.000 | VALLEY NATIONAL BANCORP 15/06/2031 FRN | USD | 306.476,85 | 0,21 |
| 600.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.875% 08/02/2029 | USD | 581.048,95 | 0,41 |
| 200.000 | VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO INC 4.250% 01/12/2026 | USD | 180.216,54 | 0,13 |
| 125.000 | VICTORIA'S SECRET & CO 4.625% 15/07/2029 | USD | 109.624,97 | 0,08 |
| 300.000 | VMWARE INC 4.700% 15/05/2030 | USD | 305.084,02 | 0,21 |
| 122.000 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 4.100% 15/04/2050 | USD | 116.941,24 | 0,08 |
| 1.100.000 | WI TREASURY SE 2.625% 02/15/29 | USD | 1.035.150,35 | 0,72 |
| | | | **32.982.351,54** | **23,03** |
| | **Australien** | | | |
| 1.030.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 1.500% 21/06/2031 | AUD | 645.050,57 | 0,45 |
| 1.400.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.250% 21/05/2028 | AUD | 938.520,05 | 0,66 |
| 2.400.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.500% 21/05/2030 | AUD | 1.637.343,09 | 1,13 |
| 1.500.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 3.250% 21/04/2029 | AUD | 1.073.290,88 | 0,75 |
| 300.000 | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 12/09/2034 FRN EMTN | USD | 274.110,43 | 0,19 |
| 307.000 | SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031 | USD | 269.324,08 | 0,19 |
| 300.000 | WESTPAC BANKING CORP 24/07/2034 FRN | USD | 281.181,04 | 0,20 |
| | | | **5.118.820,14** | **3,57** |
| | **Niederlande** | | | |
| 200.000 | LKQ EUROPEAN HOLDINGS BV 4.125% 01/04/2028 | EUR | 214.204,95 | 0,15 |
| 2.500.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND ZCP 15/07/2031 | EUR | 2.519.216,33 | 1,77 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 680.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 2.500% 15/01/2033 | EUR | 874.147,81 | 0,61 |
| 290.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 4.000% 15/01/2037 | EUR | 460.705,82 | 0,32 |
| 150.000 | NOBIAN FINANCE BV 3.625% 15/07/2026 | EUR | 148.755,00 | 0,10 |
| 200.000 | SIGMA HOLDCO BV 5.750% 15/05/2026 | EUR | 190.819,66 | 0,13 |
| 200.000 | TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 3.750% 15/08/2026 | EUR | 204.701,81 | 0,14 |
| 200.000 | VZ VENDOR FINANCING II BV 2.875% 15/01/2029 | EUR | 197.783,60 | 0,14 |
| 100.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2.500% 23/10/2027 | EUR | 102.206,04 | 0,07 |
| 100.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 3.000% 23/10/2029 | EUR | 104.012,51 | 0,07 |
| | | | **5.016.553,53** | **3,50** |
| | **Frankreich** | | | |
| 100.000 | ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025 | EUR | 97.004,90 | 0,07 |
| 200.000 | CONSTELLIUM SE 4.250% 15/02/2026 | EUR | 202.500,00 | 0,14 |
| 100.000 | FAURECIA SE 2.375% 15/06/2027 | EUR | 100.518,55 | 0,07 |
| 1.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/11/2030 | EUR | 994.936,89 | 0,70 |
| 380.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT ZCP 25/11/2031 | EUR | 374.154,22 | 0,26 |
| 890.422 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 01/03/2029 | EUR | 1.027.464,22 | 0,72 |
| 300.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.250% 25/05/2034 | EUR | 334.381,35 | 0,23 |
| 595.053 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.150% 25/07/2032 | EUR | 931.024,98 | 0,65 |
| 100.000 | KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026 | EUR | 100.500,00 | 0,07 |
| 200.000 | LOXAM SAS 4.250% 15/04/2024 | EUR | 201.838,94 | 0,14 |
| 100.000 | PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028 | EUR | 101.250,00 | 0,07 |
| 150.000 | PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026 | EUR | 152.402,51 | 0,11 |
| 200.000 | QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024 | EUR | 206.000,00 | 0,14 |
| 100.000 | RUBIS TERMINAL INFRA SAS 5.625% 15/05/2025 | EUR | 105.030,74 | 0,07 |
| | | | **4.929.007,30** | **3,44** |
| | **Finnland** | | | |
| 1.700.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 0.125% 15/09/2031 | EUR | 1.716.331,97 | 1,20 |
| 1.120.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 0.500% 15/09/2029 | EUR | 1.178.601,36 | 0,82 |
| 640.000 | FINLAND GOVERNMENT BOND 1.125% 15/04/2034 | EUR | 715.521,08 | 0,50 |
| | | | **3.610.454,41** | **2,52** |
| | **Kanada** | | | |
| 11.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 4.875% 01/06/2028 | USD | 9.841,94 | 0,01 |
| 84.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 6.125% 15/04/2025 | USD | 74.031,01 | 0,05 |
| 3.208.000 | CANADIAN GOVERNMENT BOND 1.500% 01/06/2031 | CAD | 2.183.084,59 | 1,52 |
| 810.000 | CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.750% 01/06/2029 | CAD | 729.316,87 | 0,51 |
| 500.000 | TECK RESOURCES LTD 3.900% 15/07/2030 | USD | 468.566,00 | 0,33 |
| | | | **3.464.840,41** | **2,42** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 100.000 | EC FINANCE PLC 3.000% 15/10/2026 | EUR | 100.750,00 | 0,07 |
| 100.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 2.500% 15/01/2026 | EUR | 100.878,57 | 0,07 |
| 250.000 | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 6.500% 15/02/2025 | USD | 240.812,94 | 0,17 |
| 100.000 | MATALAN FINANCE PLC 6.750% 31/01/2023 | GBP | 109.524,27 | 0,08 |
| 100.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 6.500% 15/02/2023 | EUR | 101.745,46 | 0,07 |
| 330.000 | UNITED KINGDOM GILT 0.250% 31/07/2031 | GBP | 356.739,01 | 0,25 |
| 500.000 | UNITED KINGDOM GILT 0.625% 31/07/2035 | GBP | 536.242,28 | 0,37 |
| 180.000 | UNITED KINGDOM GILT 1.250% 22/10/2041 | GBP | 205.292,65 | 0,14 |
| 950.000 | UNITED KINGDOM GILT 4.500% 07/09/2034 | GBP | 1.550.153,20 | 1,09 |
| 125.000 | VMED O2 UK FINANCING I PLC 3.250% 31/01/2031 | EUR | 128.329,05 | 0,09 |
| | | | **3.430.467,43** | **2,40** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Österreich** | | | |
| 350.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2030 | EUR | 352.043,54 | 0,25 |
| 2.100.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND ZCP 20/02/2031 | EUR | 2.096.068,91 | 1,46 |
| | | | **2.448.112,45** | **1,71** |
| | **Deutschland** | | | |
| 1.707.538 | DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.500% 15/04/2030 | EUR | 2.110.191,46 | 1,48 |
| 100.000 | IHO VERWALTUNGS GMBH 3.625% 15/05/2025 | EUR | 101.731,79 | 0,07 |
| 100.000 | TUI CRUISES GMBH 6.500% 15/05/2026 | EUR | 103.000,00 | 0,07 |
| | | | **2.314.923,25** | **1,62** |
| | **Schweden** | | | |
| 11.755.000 | SWEDEN GOVERNMENT BOND 0.125% 12/05/2031 | SEK | 1.131.710,29 | 0,79 |
| 10.815.000 | SWEDEN GOVERNMENT BOND 0.750% 12/11/2029 | SEK | 1.105.510,10 | 0,77 |
| | | | **2.237.220,39** | **1,56** |
| | **Irland** | | | |
| 400.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND ZCP 18/10/2031 | EUR | 392.893,65 | 0,27 |
| 610.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 0.200% 18/10/2030 | EUR | 617.036,58 | 0,43 |
| 1.000.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 0.400% 15/05/2035 | EUR | 998.950,80 | 0,70 |
| | | | **2.008.881,03** | **1,40** |
| | **Spanien** | | | |
| 1.800.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 0.500% 31/10/2031 | EUR | 1.807.806,74 | 1,26 |
| | | | **1.807.806,74** | **1,26** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 100.000 | ADLER GROUP SA 1.875% 14/01/2026 | EUR | 84.500,00 | 0,06 |
| 100.000 | ADLER GROUP SA 2.250% 27/04/2027 | EUR | 83.500,00 | 0,06 |
| 200.000 | ALTICE FRANCE HOLDING SA 8.000% 15/05/2027 | EUR | 213.039,76 | 0,15 |
| 200.000 | LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01/04/2024 | EUR | 201.637,43 | 0,14 |
| 100.000 | MOTION FINCO SARL 7.000% 15/05/2025 | EUR | 105.171,64 | 0,07 |
| 150.000 | SUMMER BC HOLDCO B SARL 5.750% 31/10/2026 | EUR | 157.125,00 | 0,11 |
| | | | **844.973,83** | **0,59** |
| | **Italien** | | | |
| 100.000 | ATLANTIA SPA 1.875% 12/02/2028 | EUR | 104.000,00 | 0,07 |
| 100.000 | PRO-GEST SPA 3.250% 15/12/2024 | EUR | 97.588,50 | 0,07 |
| | | | **201.588,50** | **0,14** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 150.000 | CLARIOS GLOBAL LP / CLARIOS US FINANCE CO 8.500% 15/05/2027 | USD | 137.701,91 | 0,11 |
| | | | **137.701,91** | **0,11** |
| | **Jersey** | | | |
| 100.000 | WHEEL BIDCO LTD 6.750% 15/07/2026 | GBP | 117.179,78 | 0,08 |
| | | | **117.179,78** | **0,08** |
| | **Liberia** | | | |
| 60.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 11.500% 01/06/2025 | USD | 59.107,30 | 0,04 |
| | | | **59.107,30** | **0,04** |
| | | | **70.729.989,94** | **49,39** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Börsengehandelte Wertpapiere** | | | |
| | **Jersey** | | | |
| 35.514 | WISDOMTREE CARBON | USD | 758.114,12 | 0,53 |
| | | | **758.114,12** | **0,53** |
| | | | **758.114,12** | **0,53** |
| | **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | |
| | **Offene Fonds** | | | |
| | **Jersey** | | | |
| 74.263 | WISDOMTREE WTI CRUDE OIL | USD | 445.501,11 | 0,31 |
| | | | **445.501,11** | **0,31** |
| | | | **445.501,11** | **0,31** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **136.939.386,10** | **95,63** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | **Credit Default Swaps** | | | |
| CDX ITRAXX EUROPE SERIES 36 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2026 | EUR | 5.700.000,00 | 148.837,32 |
| CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 37 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | USD | 540.000,00 | (43.366,57) |
| CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 37 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | USD | 850.000,00 | (68.262,19) |
| CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 37 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 6.900.000,00 | (142.082,02) |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | EUR | 1.500.000,00 | (177.062,37) |
| | | | | | | **(281.935,83)** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | **Devisentermingeschäfte** | | | |
| 18.700.000,00 | USD | 15.881.811,60 | EUR | 26/11/2021 | 15.881.811,60 | 236.613,14 |
| 816.983.902,00 | JPY | 6.261.948,70 | EUR | 19/10/2021 | 6.261.948,70 | 54.885,04 |
| 1.500.000,00 | CAD | 1.010.218,29 | EUR | 26/11/2021 | 1.010.218,29 | 10.282,20 |
| 3.378.866,62 | EUR | 2.900.000,00 | GBP | 26/11/2021 | 3.378.866,62 | 8.364,78 |
| 140.000.000,00 | JPY | 1.074.033,84 | EUR | 26/11/2021 | 1.074.033,84 | 7.908,56 |
| 890.000,00 | AUD | 548.271,42 | EUR | 26/11/2021 | 548.271,42 | 5.992,58 |
| 2.756.478,81 | EUR | 356.000.000,00 | JPY | 26/11/2021 | 2.756.478,81 | 5.253,85 |
| 4.000.000,00 | SEK | 393.777,18 | EUR | 26/11/2021 | 393.777,18 | 473,39 |
| 242.109,61 | EUR | 208.000,00 | GBP | 29/10/2021 | 242.109,61 | 227,21 |
| 2.997,85 | USD | 2.526,59 | EUR | 19/10/2021 | 2.526,59 | 59,34 |
| 5,19 | EUR | 6,16 | USD | 19/10/2021 | 5,19 | (0,12) |
| 16.083,03 | EUR | 2.098.319,00 | JPY | 19/10/2021 | 16.083,03 | (140,95) |
| 115.310,46 | EUR | 15.000.000,00 | JPY | 01/10/2021 | 115.310,46 | (689,98) |
| 3.500.000,00 | NZD | 2.090.045,12 | EUR | 26/11/2021 | 2.090.045,12 | (9.693,62) |
| 5.074.015,51 | PLN | 1.122.928,43 | EUR | 19/10/2021 | 1.122.928,43 | (20.826,27) |
| 2.046.004,71 | EUR | 3.500.000,00 | NZD | 26/11/2021 | 2.046.004,71 | (34.346,79) |
| 3.049.593,44 | EUR | 31.300.000,00 | SEK | 26/11/2021 | 3.049.593,44 | (35.417,23) |
| 4.013.023,73 | EUR | 6.000.000,00 | CAD | 26/11/2021 | 4.013.023,73 | (68.978,25) |
| 5.098.587,57 | EUR | 8.300.000,00 | AUD | 26/11/2021 | 5.098.587,57 | (70.391,33) |
| 30.874.190,24 | EUR | 36.099.423,96 | USD | 29/10/2021 | 30.874.190,24 | (259.019,73) |
| 35.960.657,08 | EUR | 42.300.000,00 | USD | 26/11/2021 | 35.960.657,08 | (499.736,85) |
| | | | | | **115.936.471,66** | **(669.181,03)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| | **Futures auf Aktienindizes** | | | |
| (75) | EURO STOXX 50 17/12/2021 | EUR | 3.036.000,00 | 65.180,25 |
| (40) | MSCI EMRGING MARKETS 17/12/2021 | USD | 2.149.531,90 | 41.905,85 |
| 11 | MSCI INDIA FUTURE 17/12/2021 | USD | 960.607,19 | (9.372,71) |
| (1) | NIKKEI 225 (OSE) 09/12/2021 | JPY | 227.824,87 | 2.229,78 |
| (2) | SPI 200 FUTURES 16/12/2021 | AUD | 227.278,92 | 3.252,65 |
| (52) | S&P500 EMINI FUTURE 17/12/2021 | USD | 9.641.615,26 | 274.325,09 |
| (3) | TOPIX INDEX FUTURE 09/12/2021 | JPY | 471.077,81 | 11.037,89 |
| | | | **16.713.935,95** | **388.558,80** |
| | **Zins-Futures** | | | |
| (25) | AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/12/2021 | AUD | 2.204.424,39 | 41.694,54 |
| (31) | CANADA 10YR BOND FUTURE 20/12/2021 | CAD | 3.022.477,97 | 52.759,38 |
| 5 | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 674.650,00 | (4.100,00) |
| (31) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 5.264.420,00 | 78.847,65 |
| 17 | EURO-OAT FUTURE 08/12/2021 | EUR | 2.821.150,00 | (47.140,00) |
| (27) | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 3.931.266,92 | 67.857,77 |
| 5 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 824.291,38 | (40.048,37) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Multi Asset Premium

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| (148) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 16.806.753,96 | 177.879,91 |
| | | | **35.549.434,62** | **327.750,88** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR |
|---|---|---|---|
| | **Bezugsrechte** | | |
| 3.558 | VEOLIA ENVIRONNEMENT S.A. RIGHTS 01/10/2021 | EUR | 2.554,64 |
| 19 | HYUNDAI ENGINEERING AND CONSTRUCTION CO LTD RIGHTS 22/10/2021 | KRW | 1.107,18 |
| | | | **3.661,82** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | **(231.145,36)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **136.939.386,10** | **95,63** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(231.145,36)** | **(0,16)** |
| **Bankguthaben** | **4.067.436,59** | **2,84** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **2.416.516,11** | **1,69** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **143.192.193,44** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Protection

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 62.745.737,30 |
| | 30.09.2020 | EUR | 67.559.594,78 |
| | 30.09.2019 | EUR | 76.073.089,98 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.174,46 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.977,15 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.117,69 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 31,99 |
| | 30.09.2020 | EUR | 30,80 |
| | 30.09.2019 | EUR | 31,69 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 31,12 |
| | 30.09.2020 | EUR | 30,06 |
| | 30.09.2019 | EUR | 31,05 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 2.917 |
| | 30.09.2020 | | 3.139 |
| | 30.09.2019 | | 3.334 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 816.906 |
| | 30.09.2020 | | 878.836 |
| | 30.09.2019 | | 960.308 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 691.556 |
| | 30.09.2020 | | 827.459 |
| | 30.09.2019 | | 920.653 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,54% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 0,61% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 0,97% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | (39,20%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Protection

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **58.172.451,41** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 24.647.867,44 |
| Geldmarktinstrumente | | 33.524.583,97 |
| **Bankguthaben** | | **2.798.904,11** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **2.025.536,24** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **375.231,29** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***63.372.123,05*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(185.911,49)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(440.474,26)** |
| Futures | | (440.474,26) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(626.385,75)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***62.745.737,30*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamtaufwendungen** | | **(637.109,55)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (310.306,75) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (123.162,19) |
| Abonnementsteuer | 9 | (16.248,45) |
| Bankzinsen | | (40.416,07) |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | (146.976,09) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(637.109,55)** |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (11.426,57) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 4.230.066,12 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (928.230,17) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (107.365,10) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (89.455,24) |
| **Ergebnis** | | **2.456.479,49** |
| Zeichnungen | | 11.176.722,71 |
| Rücknahmen | | (18.447.059,68) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 67.559.594,78 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***62.745.737,30*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Protection

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Geldmarktinstrumente** | | | | |
| | **Frankreich** | | | |
| 1.500.000 | BNP PARIBAS SA ZCP 01/12/2021 | EUR | 1.501.384,34 | 2,39 |
| 2.000.000 | CDC HABITAT SA ZCP 03/01/2022 | EUR | 2.004.402,66 | 3,19 |
| 1.000.000 | CDC HABITAT SA ZCP 22/12/2021 | EUR | 1.001.180,70 | 1,60 |
| 3.000.000 | DEPARTEMENT DU LOIRET ZCP 20/10/2021 | EUR | 3.000.864,12 | 4,79 |
| 3.000.000 | LEGRAND FRANCE SA ZCP 25/10/2021 | EUR | 3.001.029,54 | 4,78 |
| 2.000.000 | METROPOLE DE LYON ZCP 03/12/2021 | EUR | 2.001.869,14 | 3,19 |
| 3.000.000 | REGION NORD ZCP 11/10/2021 | EUR | 3.000.456,24 | 4,78 |
| 2.000.000 | SAGESS ZCP 25/11/2021 | EUR | 2.000.957,28 | 3,19 |
| 1.500.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB ZCP 15/12/2021 | EUR | 1.501.782,99 | 2,39 |
| | | | **19.013.927,01** | **30,30** |
| | **Belgien** | | | |
| 1.000.000 | BRUSSELS MUNICIPALITIES REGIONAL FUND ZCP 25/02/2022 | EUR | 1.001.859,01 | 1,60 |
| 1.500.000 | BRUSSELS MUNICIPALITIES REGIONAL FUND ZCP 27/10/2021 | EUR | 1.500.535,58 | 2,39 |
| 500.000 | SOCIETE WALLONNE DU CREDIT SOCIAL ZCP 07/03/2022 | EUR | 501.054,41 | 0,80 |
| 2.500.000 | SOCIETE WALLONNE DU CREDIT SOCIAL ZCP 30/11/2021 | EUR | 2.501.978,48 | 3,98 |
| 2.000.000 | VLAAMSE GEMEENSCHAP ZCP 15/10/2021 | EUR | 2.000.401,88 | 3,19 |
| | | | **7.505.829,36** | **11,96** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.000.000 | INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA ZCP 07/01/2022 (1) | EUR | 1.000.609,27 | 1,59 |
| 2.000.000 | LAND SECURITIES GROUP PLC ZCP 19/10/2021 | EUR | 2.000.525,94 | 3,20 |
| 1.500.000 | LONDON STOCK ZCP 27/10/2021 | EUR | 1.500.513,90 | 2,39 |
| | | | **4.501.649,11** | **7,18** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 1.500.000 | INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA ZCP 28/02/2022 (1) | EUR | 1.502.841,98 | 2,40 |
| | | | **1.502.841,98** | **2,40** |
| | **Deutschland** | | | |
| 1.000.000 | DEUTSCHE BOERSE ZCP 25/10/2021 | EUR | 1.000.336,51 | 1,59 |
| | | | **1.000.336,51** | **1,59** |
| | | | **33.524.583,97** | **53,43** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 12.446 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 12.330.252,20 | 19,65 |
| 12.173 | NN (L) LIQUID EURIBOR 3M - A CAP EUR | EUR | 12.317.615,24 | 19,63 |
| | | | **24.647.867,44** | **39,28** |
| | | | **24.647.867,44** | **39,28** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **58.172.451,41** | **92,71** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Future auf Aktienindizes** | | | | |
| 385 | EURO STOXX 50 17/12/2021 | EUR | 15.584.800,00 | (440.474,26) |
| | | | **15.584.800,00** | **(440.474,26)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(440.474,26)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **58.172.451,41** | **92,71** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(440.474,26)** | **(0,70)** |
| **Bankguthaben** | **2.798.904,11** | **4,46** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **2.214.856,04** | **3,53** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **62.745.737,30** | **100,00** |

(1) Kurzfristiges Einlagenzertifikat.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 50.274.444,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 43.647.135,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 53.998.942,65 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.104,05 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.904,82 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.898,97 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 23.769,82 |
| | 30.09.2020 | PLN | 22.881,72 |
| | 30.09.2019 | PLN | 22.554,09 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.672,98 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.429,03 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.313,48 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 287,84 |
| | 30.09.2020 | EUR | 278,96 |
| | 30.09.2019 | EUR | 279,29 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 266,71 |
| | 30.09.2020 | EUR | 259,37 |
| | 30.09.2019 | EUR | 260,47 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.499,66 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.304,31 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.283,20 |
| Distribution D (Q) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 18,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 18,14 |
| | 30.09.2019 | EUR | 18,77 |
| Distribution N (Q) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 18,68 |
| | 30.09.2020 | EUR | 18,66 |
| | 30.09.2019 | EUR | 19,25 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 232,74 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 1.052 |
| | 30.09.2020 | | 1.575 |
| | 30.09.2019 | | 1.942 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | | 30 |
| | 30.09.2020 | | 30 |
| | 30.09.2019 | | 30 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | | 0.30 |
| | 30.09.2020 | | 7 |
| | 30.09.2019 | | 7 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 44 |
| | 30.09.2020 | 38 |
| | 30.09.2019 | 73 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 6.421 |
| | 30.09.2020 | 3.478 |
| | 30.09.2019 | 2.619 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 4.411 |
| | 30.09.2020 | 2.368 |
| | 30.09.2019 | 2.001 |
| Distribution D (Q) (EUR) | 30.09.2021 | 266 |
| | 30.09.2020 | 266 |
| | 30.09.2019 | 266 |
| Distribution N (Q) (EUR) | 30.09.2021 | 947.879 |
| | 30.09.2020 | 1.108.692 |
| | 30.09.2019 | 1.613.692 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 70 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Dividende** | | | |
| Distribution D (Q) (EUR) | 11.08.2021 | EUR | 0,15 |
| Distribution D (Q) (EUR) | 12.05.2021 | EUR | 0,15 |
| Distribution D (Q) (EUR) | 11.02.2021 | EUR | 0,15 |
| Distribution D (Q) (EUR) | 11.11.2020 | EUR | 0,15 |
| Distribution N (Q) (EUR) | 11.08.2021 | EUR | 0,15 |
| Distribution N (Q) (EUR) | 12.05.2021 | EUR | 0,15 |
| Distribution N (Q) (EUR) | 11.02.2021 | EUR | 0,15 |
| Distribution N (Q) (EUR) | 11.11.2020 | EUR | 0,15 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,43% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,45% |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 0,45% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,64% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,13% |
| Distribution D (Q) (EUR) | 30.09.2021 | 0,65% |
| Distribution N (Q) (EUR) | 30.09.2021 | 0,45% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 108,57% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **47.773.313,50** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 47.773.313,50 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **15.614,92** |
| Futures | | 15.614,92 |
| **Bankguthaben** | | **1.682.734,31** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **78.277,00** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **2.326.625,11** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***51.876.564,84*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(1.407.135,10)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(194.985,09)** |
| Devisentermingeschäfte | | (194.985,09) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(1.602.120,19)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***50.274.444,65*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **1.079.517,04** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 947.711,52 |
| Zinsen auf Swaps | | 113.921,97 |
| Sonstige Erträge | 10 | 17.883,55 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(170.983,27)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (76.378,24) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (55.724,97) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (37,77) |
| Abonnementsteuer | 9 | (12.296,35) |
| Bankzinsen | | (13.472,17) |
| Zinsen auf Swaps | | (13.073,77) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **908.533,77** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 822.525,78 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (2.165.872,52) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 2.803.365,71 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (2.391.423,13) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 283.723,99 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (275.096,29) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 2.052.370,84 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (649.993,05) |
| **Ergebnis** | | **1.388.135,10** |
| Zeichnungen | | 15.520.981,42 |
| Rücknahmen | | (9.666.192,79) |
| Ausschüttung | | (615.614,80) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 43.647.135,72 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***50.274.444,65*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 150.000 | ABBVIE INC 2.950% 21/11/2026 | USD | 138.682,07 | 0,28 |
| 500.000 | ABBVIE INC 3.200% 21/11/2029 | USD | 464.887,29 | 0,92 |
| 600.000 | AIR LEASE CORP 3.625% 01/04/2027 | USD | 556.537,56 | 1,11 |
| 200.000 | ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 3.250% 15/03/2026 | USD | 175.734,32 | 0,35 |
| 138.000 | AMERICAN BUILDERS & CONTRACTORS SUPPLY CO INC 4.000% 15/01/2028 | USD | 121.513,41 | 0,24 |
| 200.000 | AMERICAN TOWER CORP 1.300% 15/09/2025 | USD | 172.690,74 | 0,34 |
| 400.000 | AT&T INC 1.300% 05/09/2023 | EUR | 410.272,26 | 0,82 |
| 150.000 | AUTOLIV INC 0.750% 26/06/2023 | EUR | 152.055,09 | 0,30 |
| 800.000 | BANK OF AMERICA CORP 29/04/2031 FRN | USD | 704.112,40 | 1,39 |
| 400.000 | BOOKING HOLDINGS INC 3.600% 01/06/2026 | USD | 379.795,49 | 0,76 |
| 200.000 | BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 2.250% 01/04/2028 | USD | 174.127,98 | 0,35 |
| 400.000 | BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 4.050% 01/07/2030 | USD | 384.365,25 | 0,76 |
| 400.000 | BROADCOM INC 5.000% 15/04/2030 | USD | 403.315,48 | 0,80 |
| 137.000 | CELANESE US HOLDINGS LLC 1.125% 26/09/2023 | EUR | 140.215,24 | 0,28 |
| 350.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 4.500% 01/02/2024 | USD | 326.662,26 | 0,65 |
| 150.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 5.625% 15/03/2027 | USD | 135.623,63 | 0,27 |
| 275.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 4.750% 15/03/2028 | USD | 251.049,44 | 0,50 |
| 100.000 | COTY INC 3.875% 15/04/2026 | EUR | 102.383,51 | 0,20 |
| 300.000 | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP 1.050% 15/07/2026 | USD | 253.564,67 | 0,50 |
| 150.000 | CSC HOLDINGS LLC 5.250% 01/06/2024 | USD | 138.597,22 | 0,28 |
| 600.000 | CVS HEALTH CORP 1.300% 21/08/2027 | USD | 509.566,50 | 1,01 |
| 600.000 | DAE FUNDING LLC 3.375% 20/03/2028 | USD | 534.014,90 | 1,06 |
| 150.000 | DARLING INGREDIENTS INC 5.250% 15/04/2027 | USD | 134.532,96 | 0,27 |
| 300.000 | DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.300% 01/10/2029 | USD | 313.023,61 | 0,62 |
| 400.000 | FIVE CORNERS FUNDING TRUST II 2.850% 15/05/2030 | USD | 361.208,22 | 0,72 |
| 250.000 | FORD MOTOR CO 8.500% 21/04/2023 | USD | 237.112,55 | 0,47 |
| 400.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 27/01/2032 FRN | USD | 332.504,92 | 0,66 |
| 203.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.375% 15/06/2026 | USD | 177.745,09 | 0,35 |
| 150.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 6.000% 15/04/2025 | USD | 135.445,15 | 0,27 |
| 150.000 | HCA INC 5.875% 15/02/2026 | USD | 148.948,51 | 0,30 |
| 275.000 | HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 269.956,43 | 0,54 |
| 200.000 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC 1.800% 25/09/2026 | EUR | 214.574,97 | 0,43 |
| 800.000 | JPMORGAN CHASE & CO 13/05/2031 FRN | USD | 718.799,60 | 1,43 |
| 150.000 | LUMEN TECHNOLOGIES INC 5.125% 15/12/2026 | USD | 134.202,14 | 0,27 |
| 600.000 | MASCO CORP 1.500% 15/02/2028 | USD | 503.511,74 | 1,00 |
| 800.000 | METROPOLITAN LIFE GLOBAL FUNDING I 0.875% 20/01/2022 EMTN | EUR | 803.282,98 | 1,60 |
| 116.000 | MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 103.010,49 | 0,20 |
| 150.000 | MORGAN STANLEY 1.875% 30/03/2023 | EUR | 154.947,67 | 0,31 |
| 150.000 | NAVIENT CORP 6.500% 15/06/2022 | USD | 133.649,67 | 0,27 |
| 150.000 | NETFLIX INC 4.375% 15/11/2026 | USD | 144.732,45 | 0,29 |
| 200.000 | NEWMARK GROUP INC 6.125% 15/11/2023 | USD | 187.217,18 | 0,37 |
| 250.000 | NEXTERA ENERGY OPERATING PARTNERS LP 3.875% 15/10/2026 | USD | 229.673,46 | 0,46 |
| 150.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 6.125% 15/03/2024 | USD | 138.245,84 | 0,27 |
| 600.000 | ORACLE CORP 2.800% 01/04/2027 | USD | 548.453,37 | 1,09 |
| 275.000 | PATTERN ENERGY OPERATIONS LP / PATTERN ENERGY OPERATIONS INC 4.500% 15/08/2028 | USD | 247.322,02 | 0,49 |
| 136.000 | PITNEY BOWES INC 4.625% 15/03/2024 | USD | 124.173,31 | 0,25 |
| 600.000 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 2.600% 23/07/2026 | USD | 549.895,94 | 1,09 |
| 150.000 | RADIAN GROUP INC 4.500% 01/10/2024 | USD | 138.229,21 | 0,27 |
| 127.000 | REALOGY GROUP LLC / REALOGY CO-ISSUER CORP 9.375% 01/04/2027 | USD | 120.786,56 | 0,24 |
| 150.000 | SBA COMMUNICATIONS CORP 3.875% 15/02/2027 | USD | 134.029,47 | 0,27 |
| 150.000 | SEALED AIR CORP 4.875% 01/12/2022 | USD | 134.075,72 | 0,27 |
| 132.000 | SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 5.125% 01/06/2029 | USD | 123.872,73 | 0,25 |
| 250.000 | SIRIUS XM RADIO INC 5.000% 01/08/2027 | USD | 225.054,98 | 0,45 |
| 150.000 | SPRINT CORP 7.625% 01/03/2026 | USD | 156.823,27 | 0,31 |
| 136.000 | STAPLES INC 7.500% 15/04/2026 | USD | 119.006,06 | 0,24 |
| 150.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 4.750% 15/03/2025 | USD | 136.753,70 | 0,27 |
| 113.000 | TENET HEALTHCARE CORP 4.625% 15/07/2024 | USD | 99.097,14 | 0,20 |
| 600.000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 2.000% 15/10/2031 | USD | 507.068,07 | 1,01 |
| 150.000 | T-MOBILE USA INC 2.250% 15/02/2026 | USD | 130.811,16 | 0,26 |
| 200.000 | T-MOBILE USA INC 3.000% 15/02/2041 | USD | 167.327,37 | 0,33 |
| 200.000 | US BANCORP 1.450% 12/05/2025 | USD | 175.387,45 | 0,35 |
| 262.000 | VALLEY NATIONAL BANCORP 15/06/2031 FRN | USD | 229.419,81 | 0,46 |
| 150.000 | VMWARE INC 4.500% 15/05/2025 | USD | 144.223,75 | 0,29 |
| 341.000 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 3.450% 01/06/2026 | USD | 318.953,85 | 0,63 |
| | | | **16.736.857,28** | **33,29** |
| **Frankreich** | | | | |
| 250.000 | ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025 | EUR | 242.512,25 | 0,48 |
| 100.000 | BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 3.500% 01/03/2025 | EUR | 101.118,06 | 0,20 |
| 200.000 | BNP PARIBAS SA 13/04/2027 FRN EMTN | EUR | 199.187,24 | 0,40 |
| 150.000 | CMA CGM SA 5.250% 15/01/2025 | EUR | 152.128,51 | 0,30 |
| 200.000 | CREDIT AGRICOLE SA 05/06/2030 FRN EMTN | EUR | 208.127,82 | 0,41 |
| 225.000 | CROWN EUROPEAN HOLDINGS SA 2.875% 01/02/2026 | EUR | 239.606,67 | 0,48 |
| 53.017 | E-CARAT SA 10FR D 20/12/2028 FRN | EUR | 52.987,69 | 0,11 |
| 200.000 | ELIS SA 1.000% 03/04/2025 EMTN | EUR | 199.333,50 | 0,40 |
| 200.000 | ELO SACA 3.250% 23/07/2027 EMTN | EUR | 228.921,92 | 0,46 |
| 200.000 | FAURECIA SE 2.375% 15/06/2027 | EUR | 201.037,10 | 0,40 |
| 200.000 | FAURECIA SE 2.625% 15/06/2025 | EUR | 202.483,57 | 0,40 |
| 200.000 | KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026 | EUR | 201.000,00 | 0,40 |
| 150.000 | ORANGE SA FRN PERP | EUR | 166.687,50 | 0,33 |
| 250.000 | ORANGE SA FRN PERP EMTN | EUR | 296.960,05 | 0,59 |
| 200.000 | PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028 | EUR | 202.500,00 | 0,40 |
| 200.000 | PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026 | EUR | 203.203,34 | 0,40 |
| 300.000 | PSA BANQUE FRANCE SA 0.625% 21/06/2024 | EUR | 305.093,00 | 0,61 |
| 150.000 | PSA BANQUE FRANCE SA 0.750% 19/04/2023 EMTN | EUR | 152.131,41 | 0,30 |
| 202.000 | QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024 | EUR | 208.060,00 | 0,41 |
| 100.000 | SPIE SA 2.625% 18/06/2026 | EUR | 104.500,00 | 0,21 |
| 450.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 497.250,00 | 0,99 |
| | | | **4.364.829,63** | **8,68** |
| **Niederlande** | | | | |
| 455.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 15/08/2050 FRN | USD | 445.719,54 | 0,89 |
| 400.000 | CONTI-GUMMI FINANCE BV 2.125% 27/11/2023 EMTN | EUR | 418.554,73 | 0,83 |
| 200.000 | CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN | EUR | 202.576,36 | 0,40 |
| 200.000 | DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN | EUR | 209.855,67 | 0,42 |
| 200.000 | ING GROEP NV 13/11/2030 FRN | EUR | 202.547,92 | 0,40 |
| 300.000 | NIBC BANK NV 0.250% 09/09/2026 EMTN | EUR | 298.474,08 | 0,59 |
| 200.000 | NOBIAN FINANCE BV 3.625% 15/07/2026 | EUR | 198.340,00 | 0,39 |
| 250.000 | OI EUROPEAN GROUP BV 2.875% 15/02/2025 | EUR | 253.479,14 | 0,50 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 135.000 | SENSATA TECHNOLOGIES BV 4.875% 15/10/2023 | USD | 124.290,05 | 0,25 |
| 200.000 | SIGNIFY NV 2.000% 11/05/2024 | EUR | 209.885,26 | 0,42 |
| 300.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 316.157,15 | 0,63 |
| 100.000 | TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 3.750% 15/08/2026 | EUR | 102.350,91 | 0,20 |
| 500.000 | VONOVIA FINANCE BV 0.875% 03/07/2023 EMTN | EUR | 508.563,96 | 1,02 |
| 300.000 | VZ VENDOR FINANCING II BV 2.875% 15/01/2029 | EUR | 296.675,41 | 0,59 |
| | | | **3.787.470,18** | **7,53** |
| | **Deutschland** | | | |
| 1.600.000 | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN ZCP 10/03/2023 | EUR | 1.616.410,46 | 3,22 |
| 100.000 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.000% 29/05/2026 EMTN | EUR | 103.000,00 | 0,20 |
| 100.000 | HEIDELBERGCEMENT AG 2.250% 30/03/2023 EMTN | EUR | 103.098,23 | 0,21 |
| 200.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2042 FRN EMTN | EUR | 207.962,01 | 0,41 |
| 300.000 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGS-GESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN 26/05/2042 FRN EMTN | GBP | 362.066,99 | 0,72 |
| 500.000 | O2 TELEFONICA DEUTSCHLAND FINANZIERUNGS GMBH 1.750% 05/07/2025 | EUR | 528.013,74 | 1,05 |
| 100.000 | RED & BLACK AUTO GERMANY 7 UG 7 D 15/11/2024 FRN | EUR | 102.887,23 | 0,20 |
| 200.000 | SCHAEFFLER AG 1.875% 26/03/2024 EMTN | EUR | 205.769,29 | 0,41 |
| 200.000 | TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 MBH 2.000% 15/07/2025 | EUR | 198.742,52 | 0,40 |
| 200.000 | ZF FINANCE GMBH 2.750% 25/05/2027 EMTN | EUR | 207.218,29 | 0,41 |
| | | | **3.635.168,76** | **7,23** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 150.000 | AVIVA PLC 04/12/2045 FRN EMTN | EUR | 166.579,38 | 0,33 |
| 150.000 | BELLIS ACQUISITION CO PLC 3.250% 16/02/2026 | GBP | 171.459,57 | 0,34 |
| 100.000 | CMF 2020-1 PLC 2020-1 D 16/03/2024 FRN | GBP | 116.049,78 | 0,23 |
| 100.000 | EC FINANCE PLC 2.375% 15/11/2022 | EUR | 100.326,58 | 0,20 |
| 100.000 | GENESIS MORTGAGE FUNDING 2019-1 PLC 2019-1 E 15/06/2056 FRN | GBP | 116.140,56 | 0,23 |
| 150.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 2.500% 15/01/2026 | EUR | 151.317,86 | 0,30 |
| 250.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 8.000% 15/02/2023 | USD | 220.133,74 | 0,44 |
| 200.000 | NATWEST GROUP PLC 14/09/2032 FRN EMTN | EUR | 199.405,80 | 0,40 |
| 150.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN | EUR | 154.219,77 | 0,31 |
| 89.966 | TRINIDAD MORTGAGE SECURITIES 2018-1 PLC 2018-1 D 24/01/2059 FRN | GBP | 104.585,37 | 0,21 |
| 150.000 | VODAFONE GROUP PLC 1.125% 20/11/2025 EMTN | EUR | 156.815,48 | 0,31 |
| | | | **1.657.033,89** | **3,30** |
| | **Irland** | | | |
| 350.000 | AQUARIUS & INVESTMENTS PLC FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 02/10/2043 FRN EMTN | EUR | 379.294,99 | 0,75 |
| 500.000 | CCEP FINANCE IRELAND DAC ZCP 06/09/2025 | EUR | 500.534,68 | 1,00 |
| 100.000 | CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2020-1 D 15/12/2029 FRN | EUR | 103.976,39 | 0,21 |
| 200.000 | CREDIT BANK OF MOSCOW 3.875% 21/09/2026 | USD | 170.500,17 | 0,34 |
| 200.000 | C&W SENIOR FINANCING DAC 7.500% 15/10/2026 | USD | 179.209,59 | 0,36 |
| 300.000 | SOVCOMBANK VIA SOVCOM CAPITAL DAC 07/04/2030 FRN | USD | 278.972,16 | 0,55 |
| | | | **1.612.487,98** | **3,21** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 100.000 | ADLER GROUP SA 1.875% 14/01/2026 | EUR | 84.500,00 | 0,17 |
| 200.000 | ALTICE FINANCING SA 2.250% 15/01/2025 | EUR | 192.500,00 | 0,38 |
| 435.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN | EUR | 463.941,53 | 0,93 |
| 150.000 | KLEOPATRA FINCO SARL 4.250% 01/03/2026 | EUR | 147.006,32 | 0,29 |
| 300.000 | LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01/04/2024 | EUR | 302.456,15 | 0,60 |
| 300.000 | LOGICOR FINANCING SARL 1.625% 15/07/2027 EMTN | EUR | 315.865,30 | 0,63 |
| 100.000 | VIVION INVEST 3% 08/08/24/EUR/ | EUR | 97.500,00 | 0,19 |
| | | | **1.603.769,30** | **3,19** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 200.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 156.846,66 | 0,31 |
| 400.000 | EMAAR SUKUK LTD 3.635% 15/09/2026 EMTN | USD | 360.728,62 | 0,72 |
| 200.000 | GRUPO AVAL LTD 4.750% 26/09/2022 | USD | 177.100,01 | 0,35 |
| 100.000 | INDUSTRIAL SENIOR TRUST 5.500% 01/11/2022 | USD | 89.019,33 | 0,18 |
| 300.000 | SHIMAO GROUP HOLDINGS LTD 4.600% 13/07/2030 | USD | 244.067,69 | 0,49 |
| 100.000 | XLIT LTD 29/06/2047 FRN | EUR | 112.281,03 | 0,22 |
| | | | **1.140.043,34** | **2,27** |
| | **Italien** | | | |
| 149.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.125% 16/11/2023 EMTN | EUR | 149.598,47 | 0,30 |
| 425.000 | FCA BANK SPA/IRELAND 0.500% 18/09/2023 EMTN | EUR | 429.409,83 | 0,85 |
| 150.000 | INTESA SANPAOLO SPA 2.125% 30/08/2023 EMTN | EUR | 156.790,92 | 0,31 |
| 125.000 | LKQ ITALIA BONDCO DI LKQ ITALIA BONDCO GP SRL E C SAPA 3.875% 01/04/2024 | EUR | 134.690,74 | 0,27 |
| 200.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 4.000% 11/04/2024 EMTN | EUR | 213.763,94 | 0,43 |
| | | | **1.084.253,90** | **2,16** |
| | **Spanien** | | | |
| 300.000 | CELLNEX FINANCE CO SA 0.750% 15/11/2026 EMTN | EUR | 297.417,35 | 0,59 |
| 100.000 | GRIFOLS SA 1.625% 15/02/2025 | EUR | 100.230,44 | 0,20 |
| 100.000 | LORCA TELECOM BONDCO SA 4.000% 18/09/2027 | EUR | 100.590,56 | 0,20 |
| 100.000 | NH HOTEL GROUP SA 4.000% 02/07/2026 | EUR | 101.317,29 | 0,20 |
| 200.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.528% 17/01/2025 EMTN | EUR | 211.030,88 | 0,42 |
| | | | **810.586,52** | **1,61** |
| | **Dominikanische Republik** | | | |
| 300.000 | AEROPUERTOS DOMINICANOS SIGLO XXI SA 6.750% 30/03/2029 | USD | 269.956,18 | 0,54 |
| 500.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.000% 19/07/2028 | USD | 486.507,60 | 0,96 |
| | | | **756.463,78** | **1,50** |
| | **Schweden** | | | |
| 500.000 | ESSITY AB 1.125% 05/03/2025 EMTN | EUR | 518.957,58 | 1,03 |
| 225.000 | VERISURE HOLDING AB 3.500% 15/05/2023 | EUR | 227.256,54 | 0,45 |
| | | | **746.214,12** | **1,48** |
| | **Mexiko** | | | |
| 300.000 | BBVA BANCOMER SA/TEXAS 6.750% 30/09/2022 | USD | 272.096,54 | 0,53 |
| 38.462 | CEMEX SAB DE CV 2.750% 05/12/2024 | EUR | 38.825,07 | 0,08 |
| 200.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.150% 28/03/2027 | USD | 194.693,12 | 0,39 |
| 200.000 | TRUST FIBRA UNO 5.250% 15/12/2024 | USD | 190.549,89 | 0,38 |
| | | | **696.164,62** | **1,38** |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 200.000 | ARCOS DORADOS HOLDINGS INC 6.625% 27/09/2023 | USD | 186.712,06 | 0,37 |
| 300.000 | DIANJIAN HAIYU LTD FRN PERP EMTN | USD | 261.423,25 | 0,52 |
| 200.000 | NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025 | USD | 159.255,64 | 0,32 |
| | | | **607.390,95** | **1,21** |
| | **Jersey** | | | |
| 125.000 | ADIENT GLOBAL HOLDINGS LTD 3.500% 15/08/2024 | EUR | 125.986,24 | 0,25 |
| 450.000 | APTIV PLC 1.500% 10/03/2025 | EUR | 470.113,19 | 0,94 |
| | | | **596.099,43** | **1,19** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Georgien** | | | |
| 200.000 | GEORGIA INTERNATIONAL BOND 2.750% 22/04/2026 | USD | 174.763,87 | 0,35 |
| 232.000 | SILKNET JSC 11.000% 02/04/2024 | USD | 216.900,44 | 0,43 |
| 200.000 | TBC BANK JSC 5.750% 19/06/2024 EMTN | USD | 184.607,14 | 0,37 |
| | | | **576.271,45** | **1,15** |
| | **Kanada** | | | |
| 126.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 6.125% 15/04/2025 | USD | 111.046,52 | 0,22 |
| 405.000 | FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028 | EUR | 448.612,93 | 0,89 |
| | | | **559.659,45** | **1,11** |
| | **Japan** | | | |
| 550.000 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD 0.155% 23/10/2024 | EUR | 553.486,49 | 1,10 |
| | | | **553.486,49** | **1,10** |
| | **Thailand** | | | |
| 200.000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 179.775,33 | 0,36 |
| 200.000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 180.847,33 | 0,36 |
| 200.000 | TMBTHANACHART BANK PCL FRN PERP EMTN | USD | 174.451,50 | 0,34 |
| | | | **535.074,16** | **1,06** |
| | **Südkorea** | | | |
| 300.000 | HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 269.806,20 | 0,54 |
| 300.000 | HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 262.736,37 | 0,52 |
| | | | **532.542,57** | **1,06** |
| | **Island** | | | |
| 150.000 | ISLANDSBANKI HF 19/01/2024 FRN GMTN | EUR | 152.090,99 | 0,30 |
| 305.000 | LANDSBANKINN HF 1.000% 30/05/2023 EMTN | EUR | 310.333,01 | 0,62 |
| | | | **462.424,00** | **0,92** |
| | **Brasilien** | | | |
| 200.000 | BANCO DO BRASIL SA/CAYMAN 3.875% 10/10/2022 | USD | 177.004,12 | 0,35 |
| 300.000 | BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 12/06/2030 | USD | 251.100,94 | 0,50 |
| | | | **428.105,06** | **0,85** |
| | **Paraguay** | | | |
| 400.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 15/04/2026 | USD | 383.333,60 | 0,76 |
| | | | **383.333,60** | **0,76** |
| | **Jordanien** | | | |
| 200.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.850% 07/07/2030 | USD | 179.092,89 | 0,36 |
| 200.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 29/01/2026 | USD | 186.037,76 | 0,37 |
| | | | **365.130,65** | **0,73** |
| | **Indonesien** | | | |
| 200.000 | INDONESIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.150% 28/07/2031 | USD | 168.911,44 | 0,33 |
| 200.000 | PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 2.300% 23/06/2025 | USD | 179.276,12 | 0,36 |
| | | | **348.187,56** | **0,69** |
| | **Rumänien** | | | |
| 300.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 26/05/2028 | EUR | 333.363,56 | 0,66 |
| | | | **333.363,56** | **0,66** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Schweiz** | | | |
| 280.000 | UBS AG/LONDON 0.010% 31/03/2026 EMTN | EUR | 279.305,03 | 0,56 |
| | | | **279.305,03** | **0,56** |
| | **Türkei** | | | |
| 300.000 | AKBANK TAS 5.000% 24/10/2022 | USD | 265.252,33 | 0,53 |
| | | | **265.252,33** | **0,53** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 250.000 | BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 4.700% 22/10/2031 | USD | 236.959,78 | 0,48 |
| | | | **236.959,78** | **0,48** |
| | **Bahamas** | | | |
| 250.000 | INTERCORP PERU LTD 3.875% 15/08/2029 | USD | 211.535,42 | 0,42 |
| | | | **211.535,42** | **0,42** |
| | **Peru** | | | |
| 200.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 25/08/2027 | USD | 190.954,02 | 0,38 |
| | | | **190.954,02** | **0,38** |
| | **Bermuda** | | | |
| 200.000 | AIRCASTLE LTD 4.250% 15/06/2026 | USD | 188.533,29 | 0,38 |
| | | | **188.533,29** | **0,38** |
| | **Kolumbien** | | | |
| 200.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 28/01/2026 | USD | 185.204,44 | 0,37 |
| | | | **185.204,44** | **0,37** |
| | **Indien** | | | |
| 200.000 | EXPORT-IMPORT BANK OF INDIA 3.375% 05/08/2026 | USD | 183.346,18 | 0,36 |
| | | | **183.346,18** | **0,36** |
| | **Mauritius** | | | |
| 200.000 | HTA GROUP LTD 7.000% 18/12/2025 | USD | 181.373,80 | 0,36 |
| | | | **181.373,80** | **0,36** |
| | **Oman** | | | |
| 200.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN | USD | 179.311,12 | 0,36 |
| | | | **179.311,12** | **0,36** |
| | **Aserbaidschan** | | | |
| 200.000 | REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 3.500% 01/09/2032 | USD | 175.878,15 | 0,35 |
| | | | **175.878,15** | **0,35** |
| | **Chile** | | | |
| 200.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.450% 31/01/2031 | USD | 171.152,32 | 0,34 |
| | | | **171.152,32** | **0,34** |
| | **Marokko** | | | |
| 200.000 | MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.375% 15/12/2027 | USD | 169.075,48 | 0,34 |
| | | | **169.075,48** | **0,34** |
| | **Panama** | | | |
| 125.000 | CARNIVAL CORP 1.875% 07/11/2022 | EUR | 124.129,30 | 0,25 |
| | | | **124.129,30** | **0,25** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Stable Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Liberia** | | | |
| 125.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 9.125% 15/06/2023 | USD | 117.287,85 | 0,23 |
| | | | **117.287,85** | **0,23** |
| | **Südafrika** | | | |
| 683.206 | K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 8.000% 31/12/2022 | EUR | 1.585,47 | 0,00 |
| | | | **1.585,47** | **0,00** |
| | | | **47.773.296,21** | **95,03** |

**Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

**Aktien**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | **Südafrika** | | | |
| 347.110 | HOLDCO 2 ORDINARY B SHARES | USD | 0,00 | 0,00 |
| | | | **0,00** | **0,00** |
| | | | **0,00** | **0,00** |

**Anleihen und andere Schuldtitel**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | **Südafrika** | | | |
| 105.210 | K2016470260 SOUTH AFRICA LTD 25.000% 31/12/2022 | USD | 17,29 | 0,00 |
| | | | **17,29** | **0,00** |
| | | | **17,29** | **0,00** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **47.773.313,50** | **95,03** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 979.797,79 | EUR | 843.324,15 | GBP | 31/12/2021 | 979.797,79 | 415,96 |
| 22.000,00 | USD | 18.863,47 | EUR | 31/12/2021 | 18.863,47 | 80,26 |
| 1.729,20 | USD | 1.457,37 | EUR | 19/10/2021 | 1.457,37 | 34,23 |
| 3,00 | EUR | 3,56 | USD | 19/10/2021 | 3,00 | (0,07) |
| 11.779,88 | EUR | 19.000,00 | AUD | 31/12/2021 | 11.779,88 | (44,12) |
| 16.211,77 | EUR | 24.000,00 | CAD | 31/12/2021 | 16.211,77 | (102,14) |
| 710.876,21 | PLN | 157.644,58 | EUR | 19/10/2021 | 157.644,58 | (3.238,63) |
| 25.120.593,02 | EUR | 29.396.526,55 | USD | 31/12/2021 | 25.120.593,02 | (192.130,58) |
| | | | | | **26.306.350,88** | **(194.985,09)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| 7 | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 944.510,00 | (5.740,00) |
| 4 | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 582.409,91 | (18.289,02) |
| (2) | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 274.763,79 | 7.671,28 |
| (36) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 4.088.129,34 | 47.867,96 |
| 44 | US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 8.354.464,18 | (4.745,66) |
| 19 | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 2.012.253,83 | (11.149,64) |
| | | | **16.256.531,05** | **15.614,92** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(179.370,17)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **47.773.313,50** | **95,03** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(179.370,17)** | **(0,36)** |
| **Bankguthaben** | **1.682.734,31** | **3,35** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **997.767,01** | **1,98** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **50.274.444,65** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 433.023.516,85 |
| | 30.09.2020 | EUR | 444.952.449,35 |
| | 30.09.2019 | EUR | 479.051.104,40 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.540,42 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.250,30 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.345,60 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 25.332,09 |
| | 30.09.2020 | PLN | 23.879,11 |
| | 30.09.2019 | PLN | 24.009,78 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.743,39 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.395,12 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.377,07 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 28,74 |
| | 30.09.2020 | EUR | 27,23 |
| | 30.09.2019 | EUR | 27,72 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 287,71 |
| | 30.09.2020 | EUR | 273,84 |
| | 30.09.2019 | EUR | 280,04 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 270,78 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 5.278,52 |
| | 30.09.2020 | CZK | 5.013,63 |
| | 30.09.2019 | CZK | 5.105,15 |
| Capitalisation X Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 259,10 |
| | 30.09.2020 | USD | 245,06 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation Y Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 261,25 |
| | 30.09.2020 | USD | 247,64 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.289,19 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.924,18 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.995,62 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.748,68 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.407,03 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.463,99 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 22,04 |
| | 30.09.2020 | EUR | 21,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 22,84 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 221,22 |
| | 30.09.2020 | EUR | 214,49 |
| | 30.09.2019 | EUR | 225,66 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 386,73 |
| | 30.09.2020 | AUD | 396,50 |
| | 30.09.2019 | AUD | - |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 242,32 |
| | 30.09.2020 | USD | 247,64 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 4.791,15 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 4.977,51 |
| | 30.09.2019 | ZAR | - |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 386,75 |
| | 30.09.2020 | AUD | 396,50 |
| | 30.09.2019 | AUD | - |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 242,52 |
| | 30.09.2020 | USD | 247,64 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 4.763,86 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 4.977,51 |
| | 30.09.2019 | ZAR | - |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 36.219 |
| | 30.09.2020 | 54.093 |
| | 30.09.2019 | 54.782 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 6.400 |
| | 30.09.2020 | 4.525 |
| | 30.09.2019 | 3.550 |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 0,78 |
| | 30.09.2020 | 9 |
| | 30.09.2019 | 9 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 1.399 |
| | 30.09.2020 | 2.503 |
| | 30.09.2019 | 2.339 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 12.497 |
| | 30.09.2020 | 15.227 |
| | 30.09.2019 | 15.810 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 30 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 37.234 |
| | 30.09.2020 | 40.138 |
| | 30.09.2019 | 39.549 |
| Capitalisation X Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 2.974 |
| | 30.09.2020 | 3.541 |
| | 30.09.2019 | - |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation Y Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 18.905 |
| | 30.09.2020 | 0,68 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 9.603 |
| | 30.09.2020 | 18.612 |
| | 30.09.2019 | 20.339 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 15.489 |
| | 30.09.2020 | 2.614 |
| | 30.09.2019 | 5.881 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 16.987 |
| | 30.09.2020 | 12.045 |
| | 30.09.2019 | 10.651 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 44 |
| | 30.09.2020 | 44 |
| | 30.09.2019 | 84 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1.251 |
| | 30.09.2020 | 0,59 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 18.542 |
| | 30.09.2020 | 0,68 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 4.300 |
| | 30.09.2020 | 0,59 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 7.208 |
| | 30.09.2020 | 0,59 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 94.187 |
| | 30.09.2020 | 21 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 15.298 |
| | 30.09.2020 | 0,59 |
| | 30.09.2019 | - |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution N (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,75 |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 4,15 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 2,50 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 56,42 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 56,42 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 2,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,56 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 56,42 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 56,42 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,76% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,79% |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 0,79% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,75% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,20% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 1,52% |
| Capitalisation X Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 1,51% |
| Capitalisation Y Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 1,53% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,16% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 0,02% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 0,75% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,19% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1,53% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 1,53% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 1,52% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1,53% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 1,53% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 1,53% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 58,71% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **421.591.828,21** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 19.873.862,11 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 401.717.966,10 |
| **Bankguthaben** | | **1.724.506,28** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **897.088,32** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **25.465.197,39** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***449.678.620,20*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(13.932.551,35)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(2.722.552,00)** |
| Devisentermingeschäfte | | (2.324.727,50) |
| Futures | | (397.824,50) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(16.655.103,35)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***433.023.516,85*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **18.339.806,82** |
| Dividenden | | 69,43 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 17.380.979,56 |
| Zinsen auf Swaps | | 706.089,34 |
| Sonstige Erträge | 10 | 252.668,49 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(3.072.030,21)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.934.384,10) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (609.658,17) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (11.870,60) |
| Abonnementsteuer | 9 | (54.854,80) |
| Bankzinsen | | (13.212,03) |
| Zinsen auf Swaps | | (448.050,51) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **15.267.776,61** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 15.048.928,68 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (16.197.142,01) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 40.461.064,75 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (43.677.975,97) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 4.420.962,32 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (4.266.081,77) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 15.365.394,34 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (487.390,86) |
| **Ergebnis** | | **25.935.536,09** |
| Zeichnungen | | 143.080.926,68 |
| Rücknahmen | | (179.600.082,75) |
| Ausschüttung | | (1.345.312,52) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 444.952.449,35 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***433.023.516,85*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Anleihen und andere Schuldtitel

**Vereinigte Staaten**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 300.000 | AIR LEASE CORP 3.625% 01/04/2027 | USD | 278.268,78 | 0,06 |
| 1.500.000 | ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 3.500% 15/03/2029 | USD | 1.289.025,69 | 0,30 |
| 1.263.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026 | USD | 1.153.044,16 | 0,27 |
| 2.000.000 | AMAZON.COM INC 3.100% 12/05/2051 | USD | 1.816.193,61 | 0,42 |
| 1.685.000 | AMERICAN AIRLINES INC 11.750% 15/07/2025 | USD | 1.798.544,65 | 0,42 |
| 1.500.000 | AMERICAN BUILDERS & CONTRACTORS SUPPLY CO INC 4.000% 15/01/2028 | USD | 1.320.798,02 | 0,31 |
| 2.500.000 | AMERICAN TOWER CORP 3.950% 15/03/2029 | USD | 2.402.063,96 | 0,55 |
| 1.711.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 01/03/2027 | USD | 1.525.896,14 | 0,35 |
| 1.200.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 15/01/2028 | USD | 1.072.964,43 | 0,25 |
| 638.000 | ANTERO RESOURCES CORP 7.625% 01/02/2029 | USD | 615.161,44 | 0,14 |
| 800.000 | ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.250% 01/04/2028 | USD | 713.023,45 | 0,16 |
| 1.700.000 | ARROW BIDCO LLC 9.500% 15/03/2024 | USD | 1.504.513,84 | 0,35 |
| 2.250.000 | AT&T INC 4.850% 01/03/2039 | USD | 2.326.405,67 | 0,54 |
| 1.500.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/04/2032 FRN | USD | 1.321.232,33 | 0,31 |
| 3.000.000 | BANK OF AMERICA CORP 29/04/2031 FRN | USD | 2.640.421,52 | 0,61 |
| 1.600.000 | BAUSCH HEALTH AMERICAS INC 8.500% 31/01/2027 | USD | 1.472.530,95 | 0,34 |
| 700.000 | BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 7.625% 15/12/2025 | USD | 652.931,16 | 0,15 |
| 3.600.000 | BOARDWALK PIPELINES LP 4.450% 15/07/2027 | USD | 3.494.658,71 | 0,80 |
| 1.000.000 | BOOKING HOLDINGS INC 4.625% 13/04/2030 | USD | 1.026.141,51 | 0,24 |
| 2.300.000 | BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 4.050% 01/07/2030 | USD | 2.210.100,19 | 0,51 |
| 1.500.000 | BROADCOM INC 3.419% 15/04/2033 | USD | 1.341.286,79 | 0,31 |
| 1.000.000 | BROADCOM INC 5.000% 15/04/2030 | USD | 1.008.288,70 | 0,23 |
| 2.000.000 | BROWN & BROWN INC 2.375% 15/03/2031 | USD | 1.720.023,19 | 0,40 |
| 1.150.000 | CABLEVISION SYSTEMS CORP 5.875% 15/09/2022 | USD | 1.026.171,00 | 0,24 |
| 1.144.000 | CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC 4.750% 01/02/2028 | USD | 1.020.528,56 | 0,24 |
| 238.000 | CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028 | USD | 206.350,91 | 0,05 |
| 1.774.000 | CENTENE CORP 2.500% 01/03/2031 | USD | 1.508.655,14 | 0,35 |
| 950.000 | CENTENE CORP 3.375% 15/02/2030 | USD | 848.433,15 | 0,20 |
| 550.000 | CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC 5.375% 15/01/2026 | USD | 464.953,58 | 0,11 |
| 340.000 | CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC 6.875% 01/04/2027 | USD | 298.869,83 | 0,07 |
| 750.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 3.700% 01/04/2051 | USD | 626.527,94 | 0,14 |
| 500.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 4.200% 15/03/2028 | USD | 482.098,64 | 0,11 |
| 1.350.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 6.384% 23/10/2035 | USD | 1.529.964,42 | 0,35 |
| 1.200.000 | CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026 | EUR | 1.224.000,00 | 0,28 |
| 154.000 | CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 3.250% 31/01/2032 | USD | 133.380,46 | 0,03 |
| 1.275.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.625% 15/02/2025 | USD | 1.151.456,29 | 0,27 |
| 2.250.000 | CITIGROUP INC 20/03/2030 FRN | USD | 2.182.594,51 | 0,50 |
| 1.500.000 | CITIGROUP INC 29/01/2031 FRN | USD | 1.328.083,63 | 0,31 |
| 2.500.000 | CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 3.250% 30/04/2030 | USD | 2.312.375,41 | 0,53 |
| 1.773.000 | CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 3.875% 01/07/2028 | USD | 1.530.068,25 | 0,35 |
| 1.025.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 4.750% 15/03/2028 | USD | 935.729,74 | 0,22 |
| 1.800.000 | CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875% 01/03/2031 | USD | 1.603.714,81 | 0,37 |
| 650.000 | CNX MIDSTREAM PARTNERS LP / CNX MIDSTREAM FINANCE CORP 6.500% 15/03/2026 | USD | 589.103,29 | 0,14 |
| 1.850.000 | COMSTOCK RESOURCES INC 5.875% 15/01/2030 | USD | 1.660.344,46 | 0,38 |
| 1.150.000 | COTY INC 4.000% 15/04/2023 | EUR | 1.159.496,71 | 0,27 |
| 250.000 | COTY INC 4.750% 15/04/2026 | EUR | 252.629,06 | 0,06 |
| 1.500.000 | CVS HEALTH CORP 1.875% 28/02/2031 | USD | 1.248.740,35 | 0,29 |
| 1.000.000 | CVS HEALTH CORP 4.300% 25/03/2028 | USD | 983.890,88 | 0,23 |
| 2.000.000 | DAE FUNDING LLC 3.375% 20/03/2028 | USD | 1.780.049,68 | 0,41 |
| 445.000 | DARLING INGREDIENTS INC 5.250% 15/04/2027 | USD | 399.114,45 | 0,09 |
| 1.650.000 | DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.300% 01/10/2029 | USD | 1.721.629,85 | 0,40 |
| 960.000 | DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 6.020% 15/06/2026 | USD | 987.927,32 | 0,23 |
| 3.250.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 3.125% 24/03/2031 | USD | 2.907.701,20 | 0,67 |
| 750.000 | DIEBOLD NIXDORF INC 8.500% 15/04/2024 | USD | 660.926,45 | 0,15 |
| 1.887.000 | ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.750% 30/01/2028 | USD | 1.714.360,48 | 0,40 |
| 3.250.000 | FEDEX CORP 3.250% 15/05/2041 | USD | 2.837.999,66 | 0,66 |
| 345.000 | FORD MOTOR CO 8.500% 21/04/2023 | USD | 327.215,32 | 0,08 |
| 1.250.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.386% 17/02/2026 | EUR | 1.288.392,54 | 0,30 |
| 1.500.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.000% 13/11/2030 | USD | 1.345.911,76 | 0,31 |
| 120.000 | GAP INC/THE 3.625% 01/10/2029 | USD | 103.791,16 | 0,02 |
| 180.000 | GAP INC/THE 3.875% 01/10/2031 | USD | 155.327,46 | 0,04 |
| 2.000.000 | GENERAL MOTORS CO 5.000% 01/04/2035 | USD | 2.040.857,36 | 0,47 |
| 475.000 | GENERAL MOTORS CO 6.800% 01/10/2027 | USD | 511.954,17 | 0,12 |
| 3.840.000 | GOLDEN NUGGET INC 6.750% 15/10/2024 | USD | 3.317.521,01 | 0,76 |
| 4.500.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 27/01/2032 FRN | USD | 3.740.680,34 | 0,85 |
| 1.750.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.750% 15/09/2030 | USD | 1.531.603,32 | 0,35 |
| 1.531.000 | HCA INC 3.500% 01/09/2030 | USD | 1.399.396,74 | 0,32 |
| 1.250.000 | HUB INTERNATIONAL LTD 7.000% 01/05/2026 | USD | 1.115.303,65 | 0,26 |
| 1.600.000 | IHEARTCOMMUNICATIONS INC 4.750% 15/01/2028 | USD | 1.422.194,07 | 0,33 |
| 2.111.000 | IMOLA MERGER CORP 4.750% 15/05/2029 | USD | 1.885.394,58 | 0,44 |
| 1.000.000 | IRON MOUNTAIN INC 4.875% 15/09/2029 | USD | 903.812,92 | 0,21 |
| 4.000.000 | JPMORGAN CHASE & CO 13/05/2031 FRN | USD | 3.593.998,02 | 0,82 |
| 1.000.000 | JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2032 FRN | USD | 876.257,62 | 0,20 |
| 815.000 | KOSMOS ENERGY LTD 7.125% 04/04/2026 | USD | 687.781,34 | 0,16 |
| 1.750.000 | LAREDO PETROLEUM INC 7.750% 31/07/2029 | USD | 1.512.877,16 | 0,35 |
| 2.000.000 | MASCO CORP 2.000% 01/10/2030 | USD | 1.668.886,92 | 0,39 |
| 2.000.000 | MATADOR RESOURCES CO 5.875% 15/09/2026 | USD | 1.780.546,03 | 0,41 |
| 1.000.000 | MATTEL INC 3.750% 01/04/2029 | USD | 899.573,23 | 0,21 |
| 230.000 | MATTEL INC 6.200% 01/10/2040 | USD | 255.161,12 | 0,06 |
| 1.491.000 | MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 1.324.040,02 | 0,31 |
| 1.500.000 | MPLX LP 4.700% 15/04/2048 | USD | 1.491.560,44 | 0,34 |
| 300.000 | NBM US HOLDINGS INC 6.625% 06/08/2029 | USD | 285.025,08 | 0,07 |
| 500.000 | NETFLIX INC 3.875% 15/11/2029 | EUR | 604.613,55 | 0,14 |
| 1.265.000 | NOKIA OF AMERICA CORP 6.450% 15/03/2029 | USD | 1.232.434,15 | 0,28 |
| 1.255.000 | NRG ENERGY INC 5.750% 15/01/2028 | USD | 1.152.337,16 | 0,27 |
| 900.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 2.700% 15/08/2022 | USD | 786.871,35 | 0,18 |
| 580.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.000% 15/07/2025 | USD | 597.286,48 | 0,14 |
| 600.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 6.125% 15/03/2024 | USD | 552.983,36 | 0,13 |
| 230.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 6.625% 15/01/2028 | USD | 227.662,16 | 0,05 |
| 485.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 7.125% 15/03/2026 | USD | 483.975,54 | 0,11 |
| 550.000 | PITNEY BOWES INC 6.875% 15/03/2027 | USD | 500.983,88 | 0,12 |
| 500.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 3.550% 15/12/2029 | USD | 453.744,26 | 0,10 |
| 2.000.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.900% 15/02/2045 | USD | 1.873.230,29 | 0,43 |
| 825.000 | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 5.250% 15/04/2024 | USD | 759.146,84 | 0,18 |
| 440.000 | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 5.750% 15/04/2026 | USD | 410.560,20 | 0,09 |
| 700.000 | PRIMO WATER HOLDINGS INC 4.375% 30/04/2029 | USD | 601.071,23 | 0,14 |
| 1.300.000 | RAIN CII CARBON LLC / CII CARBON CORP 7.250% 01/04/2025 | USD | 1.151.191,31 | 0,27 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 900.000 | RANGE RESOURCES CORP 8.250% 15/01/2029 | USD | 873.625,62 | 0,20 |
| 200.000 | RESORTS WORLD LAS VEGAS LLC / RWLV CAPITAL INC 4.625% 16/04/2029 | USD | 175.533,93 | 0,04 |
| 500.000 | SCRIPPS ESCROW II INC 3.875% 15/01/2029 | USD | 432.823,79 | 0,10 |
| 400.000 | SCRIPPS ESCROW II INC 5.375% 15/01/2031 | USD | 339.331,79 | 0,08 |
| 1.816.000 | SIZZLING PLATTER LLC / SIZZLING PLATTER FINANCE CORP 8.500% 28/11/2025 | USD | 1.617.646,23 | 0,37 |
| 1.100.000 | SPRINT CAPITAL CORP 6.875% 15/11/2028 | USD | 1.212.262,79 | 0,28 |
| 1.643.000 | STAPLES INC 7.500% 15/04/2026 | USD | 1.437.698,21 | 0,33 |
| 2.065.000 | SUNCOKE ENERGY INC 4.875% 30/06/2029 | USD | 1.774.731,74 | 0,41 |
| 250.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.000% 15/01/2032 | USD | 222.879,14 | 0,05 |
| 1.150.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.375% 01/02/2027 | USD | 1.027.297,53 | 0,24 |
| 180.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 6.500% 15/07/2027 | USD | 167.445,63 | 0,04 |
| 547.000 | TENET HEALTHCARE CORP 4.250% 01/06/2029 | USD | 479.365,12 | 0,11 |
| 49.000 | TENET HEALTHCARE CORP 4.625% 15/07/2024 | USD | 42.971,33 | 0,01 |
| 200.000 | TENET HEALTHCARE CORP 6.250% 01/02/2027 | USD | 179.363,90 | 0,04 |
| 893.000 | T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029 | USD | 778.297,70 | 0,18 |
| 383.000 | T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031 | USD | 333.431,80 | 0,08 |
| 3.250.000 | T-MOBILE USA INC 3.000% 15/02/2041 | USD | 2.719.069,74 | 0,62 |
| 325.000 | T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031 | USD | 295.967,50 | 0,07 |
| 106.000 | UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.750% 15/01/2032 | USD | 92.533,66 | 0,02 |
| 1.750.000 | UNIVISION COMMUNICATIONS INC 4.500% 01/05/2029 | USD | 1.537.599,92 | 0,36 |
| 1.488.000 | VALLEY NATIONAL BANCORP 15/06/2031 FRN | USD | 1.302.964,44 | 0,30 |
| 1.000.000 | VMWARE INC 4.700% 15/05/2030 | USD | 1.016.946,71 | 0,23 |
| 1.291.000 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 4.100% 15/04/2050 | USD | 1.237.468,37 | 0,29 |
| 500.000 | W&T OFFSHORE INC 9.750% 01/11/2023 | USD | 409.734,17 | 0,09 |
| | | | **140.581.534,90** | **32,47** |
| | **Niederlande** | | | |
| 1.740.000 | ALLIANDER NV FRN PERP | EUR | 1.808.079,33 | 0,42 |
| 350.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 15/08/2050 FRN | USD | 342.861,18 | 0,08 |
| 2.430.000 | ATRADIUS FINANCE BV 23/09/2044 FRN | EUR | 2.712.465,36 | 0,63 |
| 1.100.000 | DARLING GLOBAL FINANCE BV 3.625% 15/05/2026 | EUR | 1.119.188,15 | 0,26 |
| 2.000.000 | DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV 9.000% 15/07/2025 | EUR | 2.170.910,36 | 0,50 |
| 325.000 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2020-1 BV 2020-1 D 28/07/2054 FRN | EUR | 325.762,42 | 0,08 |
| 285.000 | DUTCH PROPERTY FINANCE 2021-1 BV 2021-1 D 28/07/2058 FRN | EUR | 288.401,12 | 0,07 |
| 1.000.000 | EDML 2017-1 BV 2017-1 E 28/10/2022 FRN | EUR | 996.970,71 | 0,23 |
| 1.300.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 1.334.144,81 | 0,31 |
| 118.994 | MAGOI 2019 BV 2019-1 E 27/07/2039 FRN | EUR | 119.560,57 | 0,03 |
| 290.000 | MDGH - GMTN BV 2.875% 07/11/2029 EMTN | USD | 263.844,97 | 0,06 |
| 280.000 | MDGH - GMTN BV 3.700% 07/11/2049 | USD | 264.021,02 | 0,06 |
| 200.000 | MDGH - GMTN BV 3.950% 21/05/2050 GMTN | USD | 196.491,07 | 0,05 |
| 235.000 | METINVEST BV 7.650% 01/10/2027 | USD | 220.027,12 | 0,05 |
| 600.000 | METINVEST BV 7.750% 17/10/2029 | USD | 559.195,67 | 0,13 |
| 1.200.000 | MINEJESA CAPITAL BV 4.625% 10/08/2030 | USD | 1.071.308,18 | 0,25 |
| 1.000.000 | NOBEL BIDCO BV 3.125% 15/06/2028 | EUR | 993.750,00 | 0,23 |
| 1.500.000 | NOBIAN FINANCE BV 3.625% 15/07/2026 | EUR | 1.487.549,99 | 0,34 |
| 1.125.000 | OI EUROPEAN GROUP BV 2.875% 15/02/2025 | EUR | 1.140.656,11 | 0,26 |
| 1.892.000 | SIGMA HOLDCO BV 5.750% 15/05/2026 | EUR | 1.805.153,95 | 0,42 |
| 1.150.000 | SIGNIFY NV 2.375% 11/05/2027 | EUR | 1.269.376,42 | 0,29 |
| 600.000 | STICHTING AK RABOBANK CERTIFICATEN 19.436% PERP STEP-UP | EUR | 862.561,00 | 0,20 |
| 4.410.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 4.647.510,03 | 1,06 |
| 1.500.000 | TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 3.750% 15/08/2026 | EUR | 1.535.263,59 | 0,35 |
| 450.000 | VIVO ENERGY INVESTMENTS BV 5.125% 24/09/2027 | USD | 410.722,15 | 0,09 |
| 1.000.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 1.104.866,41 | 0,26 |
| 1.750.000 | VZ VENDOR FINANCING II BV 2.875% 15/01/2029 | EUR | 1.730.606,54 | 0,40 |
| 700.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2.500% 23/10/2027 | EUR | 715.442,31 | 0,17 |
| 700.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 3.000% 23/10/2029 | EUR | 728.087,54 | 0,17 |
| 400.000 | ZIGGO BV 2.875% 15/01/2030 | EUR | 403.900,89 | 0,09 |
| | | | **32.628.678,97** | **7,54** |
| | **Frankreich** | | | |
| 400.000 | ACCOR SA FRN PERP | EUR | 413.238,81 | 0,10 |
| 700.000 | ACCOR SA FRN PERP | EUR | 674.760,70 | 0,16 |
| 700.000 | ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025 | EUR | 679.034,30 | 0,16 |
| 1.271.000 | ALTICE FRANCE SA 3.375% 15/01/2028 | EUR | 1.223.337,50 | 0,28 |
| 350.000 | ALTICE FRANCE SA 4.125% 15/01/2029 | EUR | 346.509,02 | 0,08 |
| 3.700.000 | CCR RE SA 15/07/2040 FRN | EUR | 4.052.006,35 | 0,94 |
| 300.000 | CFHL-1 2014 28/04/2054 FRN | EUR | 302.081,25 | 0,07 |
| 1.250.000 | CMA CGM SA 7.500% 15/01/2026 | EUR | 1.384.174,39 | 0,32 |
| 1.250.000 | CONSTELLIUM SE 4.250% 15/02/2026 | EUR | 1.265.625,00 | 0,29 |
| 265.083 | E-CARAT SA 10FR E 20/12/2028 FRN | EUR | 263.817,76 | 0,06 |
| 1.100.000 | FAURECIA SE 3.750% 15/06/2028 | EUR | 1.144.798,08 | 0,26 |
| 288.869 | FCT AUTONORIA 2019 2019-1 E 25/09/2035 FRN | EUR | 292.152,94 | 0,07 |
| 200.000 | FCT NORIA 2021 2021-1 E 25/10/2049 FRN | EUR | 203.040,87 | 0,05 |
| 750.000 | KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026 | EUR | 753.750,00 | 0,17 |
| 1.250.000 | LOXAM SAS 3.250% 14/01/2025 | EUR | 1.259.795,99 | 0,29 |
| 569.000 | PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028 | EUR | 576.112,50 | 0,13 |
| 1.100.000 | PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026 | EUR | 1.117.618,37 | 0,26 |
| 1.500.000 | QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024 | EUR | 1.545.000,00 | 0,36 |
| 835.000 | RUBIS TERMINAL INFRA SAS 5.625% 15/05/2025 | EUR | 877.006,68 | 0,20 |
| 300.000 | TEREOS FINANCE GROUPE I SA 4.125% 16/06/2023 | EUR | 304.875,00 | 0,07 |
| 335.000 | TEREOS FINANCE GROUPE I SA 7.500% 30/10/2025 | EUR | 360.125,00 | 0,08 |
| 100.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 110.500,00 | 0,03 |
| 4.030.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 4.126.216,09 | 0,94 |
| 750.000 | VALLOUREC SA 8.500% 30/06/2026 | EUR | 768.980,88 | 0,18 |
| | | | **24.044.557,48** | **5,55** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 400.000 | AVIVA PLC 04/12/2045 FRN EMTN | EUR | 444.211,69 | 0,10 |
| 1.000.000 | BELLIS ACQUISITION CO PLC 3.250% 16/02/2026 | GBP | 1.143.063,81 | 0,26 |
| 100.000 | BELLIS FINCO PLC 4.000% 16/02/2027 | GBP | 113.753,99 | 0,03 |
| 180.000 | CASTELL 2020-1 PLC -2020-1 C 25/09/2052 FRN | GBP | 213.340,00 | 0,05 |
| 899.000 | CHESTER B1 ISSUER PLC B1 D 17/04/2023 FRN | GBP | 1.044.319,58 | 0,24 |
| 500.000 | CMF 2020-1 PLC 2020-1 D 16/03/2024 FRN | GBP | 580.248,89 | 0,13 |
| 1.600.000 | EC FINANCE PLC 2.375% 15/11/2022 | EUR | 1.605.225,23 | 0,37 |
| 642.000 | EC FINANCE PLC 3.000% 15/10/2026 | EUR | 646.815,00 | 0,15 |
| 400.000 | EG GLOBAL FINANCE PLC 4.375% 07/02/2025 | EUR | 397.500,00 | 0,09 |
| 750.000 | EG GLOBAL FINANCE PLC 6.250% 30/10/2025 | EUR | 766.875,00 | 0,18 |
| 750.000 | GAZPROM PJSC VIA GAZ FINANCE PLC FRN PERP | EUR | 777.196,60 | 0,18 |
| 499.998 | GENESIS MORTGAGE FUNDING 2019-1 PLC 2019-1 E 15/06/2056 FRN | GBP | 580.702,83 | 0,13 |
| 300.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC 3.750% 15/07/2026 | EUR | 308.350,31 | 0,07 |
| 1.300.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 2.500% 15/01/2026 | EUR | 1.311.421,45 | 0,30 |
| 316.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 3.375% 15/01/2026 | USD | 275.514,79 | 0,06 |
| 850.000 | MATALAN FINANCE PLC 6.750% 31/01/2023 | GBP | 930.956,23 | 0,21 |
| 1.100.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 6.500% 15/02/2023 | EUR | 1.119.200,09 | 0,26 |
| 818.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 8.000% 15/02/2023 | USD | 720.277,59 | 0,17 |
| 1.006.325 | PETRA DIAMONDS US TREASURY PLC 10.500% 08/03/2026 | USD | 881.820,32 | 0,20 |
| 670.000 | RESIDENTIAL MORTGAGE SECURITIES 32 PLC -32X E 20/06/2070 FRN | GBP | 804.430,59 | 0,19 |
| 368.101 | RMAC SECURITIES PLC -2006-NS1X M1C 12/06/2044 FRN | EUR | 354.651,66 | 0,08 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 600.000 | STONEGATE PUB CO FINANCING 2019 PLC 8.250% 31/07/2025 | GBP | 734.122,37 | 0,17 |
| 100.000 | STRATTON MORTGAGE FUNDING 2021-3 PLC 2021-3 D 12/06/2024 FRN | GBP | 116.445,18 | 0,03 |
| 122.000 | TUDOR ROSE MORTGAGES 2020-1 PLC -2020-1 D 20/06/2048 FRN | GBP | 142.454,16 | 0,03 |
| 460.000 | TULLOW OIL PLC 10.250% 15/05/2026 | USD | 414.774,21 | 0,10 |
| 600.000 | TULLOW OIL PLC 7.000% 01/03/2025 | USD | 449.988,38 | 0,10 |
| 1.000.000 | TWIN BRIDGES PLC 2017-1 C 12/09/2044 FRN | GBP | 1.169.085,08 | 0,27 |
| 100.000 | TWIN BRIDGES 2021-1 PLC 2021-1 D 12/03/2026 FRN | GBP | 118.408,17 | 0,03 |
| 324.000 | UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 7.875% 15/07/2026 | USD | 283.304,01 | 0,07 |
| 2.000.000 | VMED O2 UK FINANCING I PLC 3.250% 31/01/2031 | EUR | 2.053.264,82 | 0,48 |
| | | | **20.501.722,03** | **4,73** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 500.000 | ADLER GROUP SA 1.875% 14/01/2026 | EUR | 422.500,00 | 0,10 |
| 400.000 | ADLER GROUP SA 2.250% 14/01/2029 | EUR | 326.000,00 | 0,08 |
| 300.000 | ADLER GROUP SA 2.250% 27/04/2027 | EUR | 250.500,00 | 0,06 |
| 400.000 | AEGEA FINANCE SARL 5.750% 10/10/2024 | USD | 354.610,60 | 0,08 |
| 1.300.000 | ALTICE FINANCING SA 2.250% 15/01/2025 | EUR | 1.251.250,00 | 0,28 |
| 250.000 | ALTICE FRANCE HOLDING SA 8.000% 15/05/2027 | EUR | 266.299,71 | 0,06 |
| 1.000.000 | ARD FINANCE SA 5.000% 30/06/2027 | EUR | 1.038.849,36 | 0,24 |
| 1.785.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.750% 25/03/2027 EMTN | EUR | 1.905.960,92 | 0,43 |
| 1.120.000 | CRYSTAL ALMOND SARL 4.250% 15/10/2024 | EUR | 1.145.200,00 | 0,26 |
| 1.000.000 | FS LUXEMBOURG SARL 10.000% 15/12/2025 | USD | 944.993,31 | 0,22 |
| 842.000 | GOL FINANCE SA 8.000% 30/06/2026 EMTN | USD | 728.866,63 | 0,17 |
| 1.000.000 | KLEOPATRA FINCO SARL 4.250% 01/03/2026 | EUR | 980.042,12 | 0,23 |
| 100.000 | KLEOPATRA HOLDINGS 2 SCA 6.500% 01/09/2026 | EUR | 94.411,65 | 0,02 |
| 1.000.000 | LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01/04/2024 | EUR | 1.008.187,16 | 0,23 |
| 1.050.000 | MEXICO REMITTANCES FUNDING FIDUCIARY ESTATE MANAGEMENT SARL 4.875% 15/01/2028 | USD | 895.280,87 | 0,21 |
| 416.462 | MILLICOM INTERNATIONAL CELLULAR SA 4.500% 27/04/2031 | USD | 375.694,40 | 0,09 |
| 1.050.000 | MIRAVET SARL 2019-1 B 26/05/2065 FRN | EUR | 1.039.357,55 | 0,24 |
| 700.000 | MOTION FINCO SARL 7.000% 15/05/2025 | EUR | 736.201,49 | 0,17 |
| 625.000 | RUMO LUXEMBOURG SARL 4.200% 18/01/2032 | USD | 529.373,88 | 0,12 |
| 1.100.000 | SILVER ARROW S.A. COMPARTMENT -10 D 15/03/2027 FRN | EUR | 1.109.921,93 | 0,26 |
| 1.150.000 | SUMMER BC HOLDCO B SARL 5.750% 31/10/2026 | EUR | 1.204.625,00 | 0,28 |
| 500.000 | TUPY OVERSEAS SA 4.500% 16/02/2031 | USD | 422.345,80 | 0,10 |
| | | | **17.030.472,38** | **3,93** |
| | **Deutschland** | | | |
| 1.000.000 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.000% 29/05/2026 EMTN | EUR | 1.030.000,00 | 0,24 |
| 2.300.000 | HANNOVER RUECK SE 08/10/2040 FRN | EUR | 2.403.023,37 | 0,55 |
| 750.000 | HT TROPLAST GMBH 9.250% 15/07/2025 | EUR | 823.085,88 | 0,19 |
| 1.200.000 | IHO VERWALTUNGS GMBH 3.625% 15/05/2025 | EUR | 1.220.781,49 | 0,28 |
| 2.900.000 | MERCK KGAA 09/09/2080 FRN | EUR | 2.983.652,91 | 0,69 |
| 1.054.043 | RED & BLACK AUTO GERMANY 6 UG 6 C 15/10/2028 FRN | EUR | 1.059.427,24 | 0,24 |
| 750.000 | SGL CARBON SE 4.625% 30/09/2024 | EUR | 763.669,97 | 0,18 |
| 1.250.000 | TECHEM VERWALTUNGSGESELLSCHAFT 675 MBH 2.000% 15/07/2025 | EUR | 1.242.140,76 | 0,29 |
| 500.000 | THYSSENKRUPP AG 1.375% 03/03/2022 | EUR | 500.249,29 | 0,12 |
| 750.000 | TUI CRUISES GMBH 6.500% 15/05/2026 | EUR | 772.500,00 | 0,18 |
| | | | **12.798.530,91** | **2,96** |
| | **Irland** | | | |
| 400.000 | ALFA BANK AO VIA ALFA BOND ISSUANCE PLC FRN PERP | USD | 355.695,95 | 0,08 |
| 600.000 | ALFA BANK AO VIA ALFA BOND ISSUANCE PLC 26/10/2031 FRN | USD | 528.904,47 | 0,12 |
| 285.000 | ARBOUR CLO VIII DAC -8X C 15/07/2033 FRN | EUR | 285.098,50 | 0,07 |
| 375.000 | BORETS FINANCE DAC 6.000% 17/09/2026 | USD | 336.907,78 | 0,08 |
| 1.250.000 | CAIRN CLO V DAC 2015-5X CR 20/07/2030 FRN | EUR | 1.250.140,50 | 0,29 |
| 170.000 | CITIZEN IRISH AUTO RECEIVABLES TRUST 2020-1 D 15/12/2029 FRN | EUR | 176.759,87 | 0,04 |
| 2.000.000 | CLOVERIE PLC FOR ZURICH INSURANCE CO LTD 24/06/2046 FRN EMTN | USD | 1.999.241,93 | 0,46 |
| 990.000 | CREDIT BANK OF MOSCOW 3.875% 21/09/2026 | USD | 843.975,83 | 0,19 |
| 809.000 | C&W SENIOR FINANCING DAC 7.500% 15/10/2026 | USD | 724.902,77 | 0,17 |
| 820.000 | FAIR OAKS LOAN FUNDING III DAC -3X C 15/10/2033 FRN | EUR | 817.894,24 | 0,19 |
| 425.000 | FINANCE IRELAND RMBS -1 D 24/06/2058 FRN | EUR | 426.438,80 | 0,10 |
| 479.000 | HACIENDA INVESTMENTS LTD VIA DME AIRPORT DAC 5.350% 08/02/2028 | USD | 435.507,74 | 0,10 |
| 250.000 | HARVEST CLO IX DAC-9X CR 15/02/2030 FRN | EUR | 244.700,28 | 0,06 |
| 150.000 | HAUS EUROPEAN LOAN CONDUIT NO 39 DAC 39X D 28/06/2026 FRN | EUR | 149.800,38 | 0,03 |
| 214.000 | PRIMROSE RESIDENTIAL 2021-1 DAC 2021-1 D 24/03/2061 FRN | EUR | 214.375,78 | 0,05 |
| 950.000 | SOVCOMBANK VIA SOVCOM CAPITAL DAC 07/04/2030 FRN | USD | 883.411,83 | 0,20 |
| 1.500.000 | TAURUS 2019-4 FIN DAC 2019-FIN4 B 18/11/2031 FRN | EUR | 1.492.646,33 | 0,34 |
| 500.000 | TORO EUROPEAN CLO 4 DAC -1X CRE 15/07/2030 FRN | EUR | 500.000,00 | 0,12 |
| | | | **11.666.402,98** | **2,69** |
| | **Kanada** | | | |
| 119.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 4.875% 01/06/2028 | USD | 106.471,94 | 0,02 |
| 600.000 | CANACOL ENERGY LTD 7.250% 03/05/2025 | USD | 543.875,83 | 0,13 |
| 3.085.000 | FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD 2.750% 29/03/2028 | EUR | 3.417.212,08 | 0,79 |
| 850.000 | FIRST QUANTUM MINERALS LTD 7.500% 01/04/2025 | USD | 753.863,31 | 0,17 |
| 600.000 | FRONTERA ENERGY CORP 7.875% 21/06/2028 | USD | 503.023,02 | 0,12 |
| 1.300.000 | GARDA WORLD SECURITY CORP 4.625% 15/02/2027 | USD | 1.121.757,55 | 0,26 |
| 1.750.000 | HUSKY III HOLDING LTD 13.000% 15/02/2025 | USD | 1.604.610,47 | 0,37 |
| 2.500.000 | TECK RESOURCES LTD 3.900% 15/07/2030 | USD | 2.342.830,00 | 0,54 |
| | | | **10.393.644,20** | **2,40** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 200.000 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC 2.625% 02/06/2026 | USD | 172.578,80 | 0,04 |
| 200.000 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC 3.750% 02/06/2031 | USD | 175.504,69 | 0,04 |
| 300.000 | ABQ FINANCE 3.125% 24/09/2024 EMTN | USD | 270.720,02 | 0,06 |
| 1.150.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 902.289,74 | 0,22 |
| 325.000 | ALDAR SUKUK NO 2 LTD 3.875% 22/10/2029 | USD | 305.694,91 | 0,07 |
| 200.000 | CDBL FUNDING 1 3.500% 24/10/2027 EMTN | USD | 182.304,81 | 0,04 |
| 400.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.250% 13/08/2024 | USD | 210.535,40 | 0,05 |
| 200.000 | CENTRAL CHINA REAL ESTATE LTD 7.750% 24/05/2024 | USD | 106.019,79 | 0,02 |
| 300.000 | CHINA AOYUAN GROUP 7.950% 21/06/2024 | USD | 221.555,55 | 0,05 |
| 200.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.000% 02/05/2025 | USD | 163.072,97 | 0,04 |
| 200.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.375% 09/04/2024 | USD | 166.823,64 | 0,04 |
| 700.000 | DP WORLD SALAAM FRN PERP | USD | 662.168,45 | 0,15 |
| 300.000 | EMAAR SUKUK LTD 3.875% 17/09/2029 EMTN | USD | 269.180,12 | 0,06 |
| 200.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP CO LTD 11.875% 01/06/2023 | USD | 55.149,98 | 0,01 |
| 200.000 | FANTASIA HOLDINGS GROUP 10.875% 02/03/2024 | USD | 53.984,16 | 0,01 |
| 1.565.620 | GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO LTD 6.500% 15/09/2024 | USD | 1.332.734,46 | 0,32 |
| 500.000 | GRAN TIERRA ENERGY INTERNATIONAL HOLDINGS LTD 6.250% 15/02/2025 | USD | 375.241,52 | 0,09 |
| 414.000 | HILONG HOLDING LTD 9.750% 18/11/2024 | USD | 308.100,97 | 0,07 |
| 200.000 | INDUSTRIAL SENIOR TRUST 5.500% 01/11/2022 | USD | 178.038,66 | 0,04 |
| 200.000 | KAISA GROUP HOLDINGS LTD 11.650% 01/06/2026 | USD | 131.637,60 | 0,03 |
| 200.000 | MUMTALAKAT SUKUK HOLDING CO 5.625% 27/02/2024 | USD | 182.372,60 | 0,04 |
| 300.000 | RED SUN PROPERTIES GROUP LTD 9.500% 20/09/2023 | USD | 234.829,22 | 0,05 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 470.000 | WEIBO CORP 1.250% 15/11/2022 | USD | 400.651,73 | 0,09 |
| 850.000 | WELL HOPE DEVELOPMENT LTD FRN PERP | USD | 748.792,42 | 0,17 |
| 880.000 | XLIT LTD 29/06/2047 FRN | EUR | 988.073,04 | 0,24 |
| 300.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD FRN PERP | USD | 168.457,40 | 0,04 |
| 300.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 7.700% 20/02/2025 | USD | 191.324,90 | 0,04 |
| 200.000 | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 6.630% 07/01/2026 | USD | 146.644,70 | 0,03 |
| 250.000 | ZHENRO PROPERTIES GROUP LTD 7.100% 10/09/2024 | USD | 189.688,61 | 0,04 |
| | | | **9.494.170,86** | **2,19** |
| | **Spanien** | | | |
| 2.100.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 2.375% 27/09/2027 EMTN | EUR | 2.310.446,38 | 0,53 |
| 1.200.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 3.000% 27/03/2031 EMTN | EUR | 1.399.911,24 | 0,32 |
| 494.000 | AI CANDELARIA SPAIN SLU 7.500% 15/12/2028 | USD | 464.418,95 | 0,11 |
| 864.292 | AUTONORIA SPAIN 2019-SP D 25/12/2035 FRN | EUR | 872.043,03 | 0,20 |
| 700.000 | AUTONORIA SPAIN 2021 FT 2021-SP E 31/01/2039 FRN | EUR | 699.999,92 | 0,16 |
| 454.344 | FT SANTANDER CONSUMER SPAIN AUTO 2020-1 2020-1 D 3.500% 20/03/2033 | EUR | 461.300,11 | 0,11 |
| 1.000.000 | LORCA TELECOM BONDCO SA 4.000% 18/09/2027 | EUR | 1.005.905,61 | 0,23 |
| 201.898 | SABADELL CONSUMO 1 FDT -1 C 24/03/2031 FRN | EUR | 203.375,92 | 0,05 |
| | | | **7.417.401,16** | **1,71** |
| | **Mexiko** | | | |
| 435.000 | BANCO MERCANTIL DEL NORTE SA/GRAND CAYMAN FRN PERP | USD | 397.475,63 | 0,09 |
| 450.000 | BBVA BANCOMER SA/TEXAS 18/01/2033 FRN | USD | 404.566,13 | 0,09 |
| 400.000 | BRASKEM IDESA SAPI 7.450% 15/11/2029 | USD | 365.912,27 | 0,08 |
| 695.000 | CIBANCO SA INSTITUCION DE BANCA MULTIPLE TRUST CIB/3332 4.375% 22/07/2031 | USD | 582.183,25 | 0,13 |
| 500.000 | GRUPO KUO SAB DE CV 5.750% 07/07/2027 | USD | 445.230,90 | 0,10 |
| 200.000 | MEXICO CITY AIRPORT TRUST 5.500% 31/07/2047 | USD | 176.108,93 | 0,04 |
| 200.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.659% 24/05/2031 | USD | 166.416,22 | 0,04 |
| 250.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.771% 24/05/2061 | USD | 191.546,40 | 0,04 |
| 150.000 | MEXICO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 15/03/2115 | EUR | 162.907,10 | 0,04 |
| 350.000 | PETROLEOS MEXICANOS 5.500% 27/06/2044 | USD | 241.961,20 | 0,06 |
| 850.000 | PETROLEOS MEXICANOS 5.950% 28/01/2031 | USD | 710.594,37 | 0,17 |
| 850.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.350% 12/02/2048 | USD | 617.166,15 | 0,15 |
| 200.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.375% 23/01/2045 | USD | 146.477,07 | 0,03 |
| 220.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.500% 13/03/2027 | USD | 200.364,83 | 0,05 |
| 165.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.500% 23/01/2029 | USD | 146.272,48 | 0,03 |
| 425.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.750% 21/09/2047 | USD | 320.045,09 | 0,07 |
| 350.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.875% 16/10/2025 | USD | 330.957,65 | 0,08 |
| 150.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.950% 28/01/2060 | USD | 113.077,03 | 0,03 |
| 225.000 | PETROLEOS MEXICANOS 7.690% 23/01/2050 | USD | 183.649,99 | 0,04 |
| 625.000 | TRUST FIBRA UNO 6.390% 15/01/2050 | USD | 638.073,12 | 0,15 |
| | | | **6.540.985,81** | **1,51** |
| | **Italien** | | | |
| 445.051 | ASSET-BACKED EUROPEAN SECURITISATION TRANSACT -17 D 15/04/2032 FRN | EUR | 449.515,55 | 0,10 |
| 305.688 | AUTOFLORENCE -1 D 25/12/2042 FRN | EUR | 310.526,13 | 0,07 |
| 300.000 | AUTOFLORENCE 2 SRL 2 D 21/12/2044 FRN | EUR | 300.157,16 | 0,07 |
| 1.000.000 | AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 2.000% 15/01/2030 | EUR | 1.048.772,36 | 0,24 |
| 650.000 | BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.875% 09/01/2026 | EUR | 653.250,00 | 0,15 |
| 250.000 | CORDUSIO RMBS 3 D - UBCASA 1 SRL -3 D 31/12/2042 FRN | EUR | 246.726,17 | 0,06 |
| 500.000 | INTESA SANPAOLO SPA FRN PERP EMTN | EUR | 554.375,00 | 0,13 |
| 1.500.000 | PRO-GEST SPA 3.250% 15/12/2024 | EUR | 1.463.827,46 | 0,34 |
| 412.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 1.625% 18/01/2029 EMTN | EUR | 403.711,30 | 0,09 |
| 650.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 2.375% 12/10/2027 EMTN | EUR | 672.750,00 | 0,16 |
| | | | **6.103.611,13** | **1,41** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 600.000 | AFRICA FINANCE CORP 4.375% 17/04/2026 EMTN | USD | 565.928,07 | 0,13 |
| 770.000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 4.125% 20/06/2024 EMTN | USD | 709.176,12 | 0,16 |
| 572.000 | ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE USA LLC / ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE PLC 2.000% 01/09/2028 | EUR | 576.473,49 | 0,13 |
| 616.000 | ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE USA LLC / ARDAGH METAL PACKAGING FINANCE PLC 3.250% 01/09/2028 | USD | 531.132,82 | 0,12 |
| 335.000 | ATP TOWER HOLDINGS LLC / ANDEAN TOWER PARTNERS COLOMBIA SAS / ANDEAN TELECOM PAR 4.050% 27/04/2026 | USD | 291.915,08 | 0,07 |
| 1.250.000 | AXALTA COATING SYSTEMS LLC / AXALTA COATING SYSTEMS DUTCH HOLDING B BV 4.750% 15/06/2027 | USD | 1.121.202,23 | 0,25 |
| 300.000 | BANQUE OUEST AFRICAINE DE DEVELOPPEMENT 4.700% 22/10/2031 | USD | 284.351,74 | 0,07 |
| 500.000 | BLACK SEA TRADE & DEVELOPMENT BANK 3.500% 25/06/2024 | USD | 455.621,29 | 0,11 |
| | | | **4.535.800,84** | **1,04** |
| | **Türkei** | | | |
| 300.000 | AKBANK TAS 5.000% 24/10/2022 | USD | 265.252,33 | 0,06 |
| 300.000 | AKBANK TAS 5.125% 31/03/2025 EMTN | USD | 258.862,33 | 0,06 |
| 500.000 | AYDEM YENILENEBILIR ENERJI AS 7.750% 02/02/2027 | USD | 421.081,50 | 0,10 |
| 610.000 | PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS 9.250% 30/04/2026 | USD | 555.640,95 | 0,13 |
| 370.000 | TURK IHRACAT KREDI BANKASI AS 5.750% 06/07/2026 | USD | 314.027,06 | 0,07 |
| 270.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 14/06/2025 | EUR | 265.725,13 | 0,06 |
| 400.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.250% 14/04/2026 | USD | 325.568,98 | 0,08 |
| 1.500.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 16/04/2043 | USD | 1.004.162,89 | 0,24 |
| 280.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.950% 15/01/2031 | USD | 228.361,59 | 0,05 |
| 250.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 14/10/2025 | USD | 221.311,58 | 0,05 |
| 250.000 | TURKIYE GARANTI BANKASI AS 5.250% 13/09/2022 | USD | 221.013,05 | 0,05 |
| 200.000 | TURKIYE IHRACAT KREDI BANKASI AS 8.250% 24/01/2024 | USD | 185.592,95 | 0,04 |
| | | | **4.266.600,34** | **0,99** |
| | **Ägypten** | | | |
| 675.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 16/04/2026 | EUR | 678.375,00 | 0,17 |
| 350.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 06/10/2025 | USD | 307.741,31 | 0,07 |
| 345.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 16/04/2030 EMTN | EUR | 329.401,86 | 0,08 |
| 355.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.800% 30/09/2027 EMTN | USD | 300.688,85 | 0,07 |
| 400.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.200% 01/03/2024 | USD | 362.913,65 | 0,08 |
| 360.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.052% 15/01/2032 EMTN | USD | 300.766,99 | 0,07 |
| 250.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 16/02/2061 | USD | 189.388,77 | 0,04 |
| 400.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.600% 01/03/2029 | USD | 357.765,11 | 0,08 |
| 260.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.903% 21/02/2048 | USD | 204.583,74 | 0,05 |
| 275.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.150% 20/11/2059 EMTN | USD | 218.701,64 | 0,05 |
| 225.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 30/09/2051 EMTN | USD | 189.875,97 | 0,04 |
| 675.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 29/05/2050 | USD | 576.391,79 | 0,13 |
| | | | **4.016.594,68** | **0,93** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Jungferninseln** | | | |
| 200.000 | BLUESTAR FINANCE HOLDINGS FRN PERP | USD | 174.355,19 | 0,04 |
| 400.000 | CAS CAPITAL NO 1 LTD FRN PERP | USD | 348.880,64 | 0,08 |
| 600.000 | CHINA HUANENG GROUP HONG KONG TREASURY MANAGEMENT HOLDING LTD FRN PERP | USD | 530.926,12 | 0,12 |
| 200.000 | DIANJIAN HAIYU LTD FRN PERP EMTN | USD | 174.282,17 | 0,04 |
| 200.000 | EASY TACTIC LTD 8.125% 27/02/2023 | USD | 125.445,58 | 0,03 |
| 500.000 | EASY TACTIC LTD 8.625% 27/02/2024 | USD | 284.677,38 | 0,07 |
| 200.000 | FORTUNE STAR BVI LTD 5.950% 19/10/2025 | USD | 175.978,08 | 0,04 |
| 300.000 | GREENLAND GLOBAL INVESTMENT LTD 5.900% 12/02/2023 EMTN | USD | 191.707,67 | 0,04 |
| 400.000 | HUANENG HONG KONG CAPITAL LTD FRN PERP | USD | 350.950,35 | 0,08 |
| 250.000 | HUARONG UNIVERSE INVESTMENT HOLDING LTD 1.625% 05/12/2022 | EUR | 204.640,13 | 0,05 |
| 300.000 | LEADER GOAL INTERNATIONAL LTD FRN PERP EMTN | USD | 265.975,50 | 0,06 |
| 700.000 | NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025 | USD | 557.394,72 | 0,13 |
| 300.000 | NWD FINANCE (BVI) LTD FRN PERP | USD | 256.067,02 | 0,06 |
| 200.000 | OCEAN LAUREL CO LTD 2.375% 20/10/2025 | USD | 170.387,23 | 0,04 |
| | | | **3.811.667,78** | **0,88** |
| | **Hongkong** | | | |
| 500.000 | BANK OF EAST ASIA LTD/THE FRN PERP | USD | 435.231,41 | 0,10 |
| 250.000 | BANK OF EAST ASIA LTD/THE 29/05/2030 FRN EMTN | USD | 226.301,53 | 0,05 |
| 200.000 | CHONG HING BANK LTD 26/07/2027 FRN | USD | 173.575,57 | 0,04 |
| 800.000 | CNAC HK FINBRIDGE CO LTD 4.125% 19/07/2027 | USD | 754.811,67 | 0,17 |
| 650.000 | FAR EAST HORIZON LTD FRN PERP EMTN | USD | 562.317,04 | 0,13 |
| 500.000 | SHANGHAI COMMERCIAL BANK LTD 29/11/2027 FRN | USD | 440.134,55 | 0,10 |
| 1.150.000 | WEICHAI INTERNATIONAL HONG KONG ENERGY GROUP CO LTD FRN PERP | USD | 1.010.444,59 | 0,24 |
| 200.000 | YANGO JUSTICE INTERNATIONAL LTD 7.500% 17/02/2025 | USD | 112.177,92 | 0,03 |
| | | | **3.714.994,28** | **0,86** |
| | **Panama** | | | |
| 217.000 | AEROPUERTO INTERNACIONAL DE TOCUMEN SA 5.125% 11/08/2061 | USD | 197.203,05 | 0,05 |
| 424.000 | BANCO GENERAL SA 4.125% 07/08/2027 | USD | 393.707,52 | 0,09 |
| 1.300.000 | CARNIVAL CORP 1.875% 07/11/2022 | EUR | 1.290.944,75 | 0,30 |
| 106.000 | CARNIVAL CORP 7.625% 01/03/2026 | USD | 97.611,06 | 0,02 |
| 500.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.252% 29/09/2032 | USD | 406.113,33 | 0,09 |
| 200.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.870% 23/07/2060 | USD | 168.730,65 | 0,04 |
| 200.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.870% 23/07/2060 | USD | 168.730,65 | 0,04 |
| 200.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 15/05/2047 | USD | 189.003,22 | 0,04 |
| 200.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 16/04/2050 | USD | 187.884,10 | 0,04 |
| 300.000 | PANAMA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 01/04/2029 | USD | 377.096,23 | 0,09 |
| | | | **3.477.024,56** | **0,80** |
| | **Schweiz** | | | |
| 2.000.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 02/04/2026 FRN EMTN | EUR | 2.204.122,30 | 0,51 |
| 1.000.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 17/07/2025 FRN EMTN | EUR | 1.029.135,87 | 0,24 |
| | | | **3.233.258,17** | **0,75** |
| | **Australien** | | | |
| 800.000 | CNOOC CURTIS FUNDING NO 1 PTY LTD 4.500% 03/10/2023 | USD | 737.838,90 | 0,17 |
| 2.833.000 | SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031 | USD | 2.485.326,13 | 0,57 |
| | | | **3.223.165,03** | **0,74** |
| | **Katar** | | | |
| 400.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 14/03/2024 | USD | 367.005,70 | 0,08 |
| 200.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 14/03/2029 | USD | 196.395,27 | 0,05 |
| 450.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.817% 14/03/2049 | USD | 500.304,48 | 0,12 |
| 600.000 | QATAR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.103% 23/04/2048 | USD | 688.113,02 | 0,15 |
| 200.000 | QATAR PETROLEUM 1.375% 12/09/2026 | USD | 171.326,88 | 0,04 |
| 450.000 | QATAR PETROLEUM 2.250% 12/07/2031 | USD | 384.108,81 | 0,09 |
| 350.000 | QATAR PETROLEUM 3.125% 12/07/2041 | USD | 302.258,23 | 0,07 |
| 450.000 | QATAR PETROLEUM 3.300% 12/07/2051 | USD | 392.783,45 | 0,09 |
| | | | **3.002.295,84** | **0,69** |
| | **Schweden** | | | |
| 1.200.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB FRN PERP EMTN | USD | 1.129.047,49 | 0,25 |
| 1.100.000 | VERISURE HOLDING AB 3.500% 15/05/2023 | EUR | 1.111.031,98 | 0,26 |
| 700.000 | VERISURE HOLDING AB 3.875% 15/07/2026 | EUR | 717.563,53 | 0,17 |
| | | | **2.957.643,00** | **0,68** |
| | **Thailand** | | | |
| 300.000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 269.663,00 | 0,06 |
| 250.000 | BANGKOK BANK PCL/HONG KONG 25/09/2034 FRN EMTN | USD | 219.642,92 | 0,05 |
| 200.000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 180.847,33 | 0,04 |
| 350.000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG 02/10/2031 FRN EMTN | USD | 304.902,95 | 0,07 |
| 500.000 | KRUNG THAI BANK PCL/CAYMAN ISLANDS FRN PERP | USD | 431.153,78 | 0,10 |
| 300.000 | MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP | USD | 263.616,26 | 0,06 |
| 800.000 | MINOR INTERNATIONAL PCL FRN PERP | USD | 690.580,65 | 0,17 |
| 600.000 | TMBTHANACHART BANK PCL FRN PERP EMTN | USD | 523.354,52 | 0,12 |
| | | | **2.883.761,41** | **0,67** |
| | **Vereinigte Arabische Emirate** | | | |
| 1.000.000 | ABU DHABI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.125% 30/09/2049 | USD | 868.709,37 | 0,20 |
| 816.000 | EMIRATES DEVELOPMENT BANK PJSC 1.639% 15/06/2026 EMTN | USD | 707.235,89 | 0,16 |
| 200.000 | EMIRATES NBD BANK PJSC FRN PERP | USD | 188.581,94 | 0,04 |
| 600.000 | EMIRATES NBD BANK PJSC FRN PERP | USD | 549.908,39 | 0,13 |
| 500.000 | NBK TIER 1 FINANCING LTD FRN PERP | USD | 431.295,60 | 0,10 |
| | | | **2.745.731,19** | **0,63** |
| | **Bermuda** | | | |
| 2.000.000 | AIRCASTLE LTD 4.250% 15/06/2026 | USD | 1.885.332,97 | 0,44 |
| 900.000 | SHENZHEN INTERNATIONAL HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 796.315,73 | 0,18 |
| | | | **2.681.648,70** | **0,62** |
| | **Oman** | | | |
| 522.000 | OMAN ARAB BANK SAOC FRN PERP | USD | 470.918,91 | 0,11 |
| 745.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 17/01/2023 | USD | 654.862,41 | 0,15 |
| 255.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN | USD | 228.621,67 | 0,05 |
| 1.000.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 08/03/2047 | USD | 833.980,95 | 0,19 |
| 555.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 17/01/2048 | USD | 473.256,03 | 0,11 |
| | | | **2.661.639,97** | **0,61** |
| | **Brasilien** | | | |
| 750.000 | BANCO BTG PACTUAL SA/CAYMAN ISLANDS 2.750% 11/01/2026 | USD | 629.634,99 | 0,14 |
| 650.000 | BANCO DO ESTADO DO RIO GRANDE DO SUL SA 28/01/2031 FRN | USD | 563.256,99 | 0,13 |
| 375.000 | BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.750% 12/09/2031 | USD | 307.656,82 | 0,07 |
| 200.000 | BRAZILIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.750% 14/01/2050 | USD | 152.836,02 | 0,04 |
| 440.000 | BRF SA 4.875% 24/01/2030 | USD | 380.764,06 | 0,09 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 200.000 | ITAU UNIBANCO HOLDING SA/CAYMAN ISLAND 21/11/2029 FRN | USD | 174.108,07 | 0,04 |
| 500.000 | OI MOVEL SA 8.750% 30/07/2026 | USD | 441.199,60 | 0,10 |
| | | | **2.649.456,55** | **0,61** |
| | **Dominikanische Republik** | | | |
| 1.025.000 | AEROPUERTOS DOMINICANOS SIGLO XXI SA 6.750% 30/03/2029 | USD | 922.350,29 | 0,21 |
| 193.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 4.500% 30/01/2030 | USD | 169.509,58 | 0,04 |
| 331.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 4.875% 23/09/2032 | USD | 292.033,08 | 0,07 |
| 305.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.300% 21/01/2041 | USD | 260.821,31 | 0,06 |
| 295.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2060 | USD | 249.667,87 | 0,06 |
| 240.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.950% 25/01/2027 | USD | 232.639,19 | 0,05 |
| 150.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.500% 15/02/2048 | USD | 138.509,88 | 0,03 |
| 150.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.850% 27/01/2045 | USD | 144.455,38 | 0,03 |
| 115.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 6.875% 29/01/2026 | USD | 114.608,11 | 0,03 |
| | | | **2.524.594,69** | **0,58** |
| | **Südkorea** | | | |
| 1.050.000 | HANWHA LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 944.321,70 | 0,22 |
| 800.000 | HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 700.630,32 | 0,16 |
| 350.000 | KYOBO LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 307.555,55 | 0,07 |
| 500.000 | TONGYANG LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 456.039,69 | 0,11 |
| | | | **2.408.547,26** | **0,56** |
| | **Ghana** | | | |
| 230.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 07/04/2025 | USD | 153.097,80 | 0,04 |
| 450.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 16/05/2029 | USD | 369.467,15 | 0,09 |
| 400.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 26/03/2027 | USD | 337.986,61 | 0,08 |
| 600.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 26/03/2032 | USD | 491.018,06 | 0,10 |
| 270.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.625% 07/04/2034 | USD | 221.918,66 | 0,05 |
| 300.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.627% 16/06/2049 | USD | 231.232,40 | 0,05 |
| 200.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 11/03/2061 | USD | 153.685,33 | 0,04 |
| 270.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 07/05/2042 | USD | 216.651,35 | 0,05 |
| | | | **2.175.057,36** | **0,50** |
| | **Ukraine** | | | |
| 200.000 | STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE 6.250% 24/06/2028 | USD | 170.485,89 | 0,04 |
| 120.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 20/06/2026 | EUR | 130.249,37 | 0,03 |
| 200.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.876% 21/05/2029 | USD | 174.751,78 | 0,04 |
| 1.600.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 25/09/2032 | USD | 1.409.819,11 | 0,33 |
| 240.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.750% 01/09/2027 | USD | 224.450,17 | 0,05 |
| | | | **2.109.756,32** | **0,49** |
| | **Rumänien** | | | |
| 280.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.625% 02/12/2040 | EUR | 260.859,45 | 0,06 |
| 156.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 14/04/2041 EMTN | EUR | 144.921,19 | 0,03 |
| 335.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.375% 28/01/2050 EMTN | EUR | 330.144,87 | 0,08 |
| 600.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.624% 26/05/2030 | EUR | 675.967,81 | 0,16 |
| 275.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 29/10/2035 EMTN | EUR | 308.304,06 | 0,07 |
| 400.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 14/02/2051 | USD | 344.171,12 | 0,08 |
| | | | **2.064.368,50** | **0,48** |
| | **Indonesien** | | | |
| 400.000 | ALAM SUTERA REALTY TBK 6.250% 02/11/2025 | USD | 274.286,75 | 0,06 |
| 200.000 | HUTAMA KARYA PERSERO PT 3.750% 11/05/2030 EMTN | USD | 186.945,51 | 0,04 |
| 200.000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 5.450% 15/05/2030 | USD | 198.707,60 | 0,05 |
| 200.000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 6.530% 15/11/2028 | USD | 209.907,76 | 0,05 |
| 200.000 | PERTAMINA PERSERO PT 4.700% 30/07/2049 EMTN | USD | 186.299,36 | 0,04 |
| 200.000 | PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA PT 6.250% 25/01/2049 | USD | 218.083,91 | 0,05 |
| 450.000 | PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.000% 30/06/2050 | USD | 372.263,63 | 0,09 |
| 200.000 | PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.375% 05/02/2050 EMTN | USD | 174.017,27 | 0,04 |
| 200.000 | PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 6.150% 21/05/2048 EMTN | USD | 213.164,14 | 0,05 |
| | | | **2.033.675,93** | **0,47** |
| | **Jersey** | | | |
| 520.000 | GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.160% 31/03/2034 | USD | 441.312,63 | 0,10 |
| 600.000 | GALAXY PIPELINE ASSETS BIDCO LTD 2.625% 31/03/2036 | USD | 510.537,32 | 0,12 |
| 300.000 | WEST CHINA CEMENT LTD 4.950% 08/07/2026 | USD | 252.152,17 | 0,06 |
| 700.000 | WHEEL BIDCO LTD 6.750% 15/07/2026 | GBP | 820.258,43 | 0,19 |
| | | | **2.024.260,55** | **0,47** |
| | **Saudi-Arabien** | | | |
| 210.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.000% 09/07/2039 | EUR | 220.015,13 | 0,05 |
| 400.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 03/02/2032 EMTN | USD | 355.079,53 | 0,08 |
| 200.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 22/10/2030 | USD | 185.108,95 | 0,04 |
| 200.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 22/04/2060 EMTN | USD | 206.483,88 | 0,05 |
| 840.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 26/10/2046 EMTN | USD | 837.639,43 | 0,20 |
| 200.000 | SAUDI GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 17/04/2049 EMTN | USD | 215.156,76 | 0,05 |
| | | | **2.019.483,68** | **0,47** |
| | **Philippinen** | | | |
| 300.000 | GLOBE TELECOM INC 3.000% 23/07/2035 | USD | 240.285,78 | 0,06 |
| 200.000 | PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.648% 10/06/2031 | USD | 164.690,12 | 0,04 |
| 1.000.000 | PHILIPPINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.650% 10/12/2045 | USD | 788.667,78 | 0,17 |
| 650.000 | SMC GLOBAL POWER HOLDINGS CORP FRN PERP | USD | 586.816,34 | 0,14 |
| | | | **1.780.460,02** | **0,41** |
| | **Peru** | | | |
| 495.882 | FENIX POWER PERU SA 4.317% 20/09/2027 | USD | 437.219,25 | 0,10 |
| 700.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.780% 01/12/2060 | USD | 510.708,18 | 0,11 |
| 640.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.230% 28/07/2121 | USD | 459.203,24 | 0,11 |
| 150.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.300% 11/03/2041 | USD | 125.843,88 | 0,03 |
| 250.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.550% 10/03/2051 | USD | 214.749,74 | 0,05 |
| | | | **1.747.724,29** | **0,40** |
| | **Chile** | | | |
| 420.000 | AES ANDES SA 07/10/2079 FRN | USD | 383.508,52 | 0,08 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 255.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.100% 07/05/2041 | USD | 212.814,66 | 0,05 |
| 300.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.100% 22/01/2061 | USD | 234.416,51 | 0,05 |
| 200.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 21/09/2071 | USD | 156.694,53 | 0,04 |
| 400.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 25/01/2050 | USD | 345.811,87 | 0,08 |
| 200.000 | EMPRESA DE LOS FERROCARRILES DEL ESTADO 3.068% 18/08/2050 | USD | 153.581,09 | 0,04 |
| 255.000 | EMPRESA DE TRANSPORTE DE PASAJEROS METRO SA 4.700% 07/05/2050 | USD | 260.659,46 | 0,06 |
| | | | **1.747.486,64** | **0,40** |
| | **Dänemark** | | | |
| 1.000.000 | DKT FINANCE APS 7.000% 17/06/2023 | EUR | 1.019.586,46 | 0,24 |
| 800.000 | DKT FINANCE APS 9.375% 17/06/2023 | USD | 704.366,45 | 0,16 |
| | | | **1.723.952,91** | **0,40** |
| | **Jordanien** | | | |
| 295.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 07/07/2025 | USD | 265.515,99 | 0,06 |
| 1.075.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.850% 07/07/2030 | USD | 962.624,25 | 0,23 |
| 550.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 10/10/2047 | USD | 491.758,31 | 0,11 |
| | | | **1.719.898,55** | **0,40** |
| | **Argentinien** | | | |
| 6.082 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 09/07/2029 | EUR | 2.367,60 | 0,00 |
| 116.400 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.750% 09/07/2035 STEP-UP | EUR | 37.236,36 | 0,01 |
| 60.473 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 09/07/2029 | USD | 20.034,42 | 0,00 |
| 2.153.150 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 09/07/2035 STEP-UP | USD | 606.586,71 | 0,14 |
| 400.000 | TELECOM ARGENTINA SA 8.000% 18/07/2026 | USD | 320.834,06 | 0,07 |
| 350.000 | TRANSPORTADORA DE GAS DEL SUR SA 6.750% 02/05/2025 | USD | 282.157,31 | 0,07 |
| 425.000 | YPF SA 8.500% 28/07/2025 | USD | 305.572,14 | 0,07 |
| | | | **1.574.788,60** | **0,36** |
| | **Bahrain** | | | |
| 200.000 | BAHRAIN GOVERMMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 30/09/2031 | USD | 171.045,65 | 0,04 |
| 420.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 19/09/2044 | USD | 333.587,39 | 0,08 |
| 400.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 20/09/2029 | USD | 370.509,93 | 0,09 |
| 280.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 14/05/2030 | USD | 267.849,92 | 0,06 |
| 200.000 | CBB INTERNATIONAL SUKUK PROGRAMME CO WLL 4.500% 30/03/2027 | USD | 181.097,09 | 0,04 |
| 200.000 | OIL AND GAS HOLDING CO BSCC/THE 7.625% 07/11/2024 | USD | 189.367,76 | 0,04 |
| | | | **1.513.457,74** | **0,35** |
| | **Liberia** | | | |
| 1.600.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.250% 15/11/2022 | USD | 1.419.099,66 | 0,33 |
| | | | **1.419.099,66** | **0,33** |
| | **Nigeria** | | | |
| 200.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 28/11/2027 EMTN | USD | 178.574,43 | 0,04 |
| 400.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 28/11/2047 EMTN | USD | 332.919,42 | 0,08 |
| 200.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.696% 23/02/2038 | USD | 170.730,41 | 0,04 |
| 370.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/09/2051 EMTN | USD | 321.537,06 | 0,07 |
| 450.000 | SEPLAT ENERGY PLC 7.750% 01/04/2026 | USD | 404.240,78 | 0,10 |
| | | | **1.408.002,10** | **0,33** |
| | **Sri Lanka** | | | |
| 200.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 18/04/2023 | USD | 113.915,43 | 0,03 |
| 800.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.200% 11/05/2027 | USD | 421.673,01 | 0,10 |
| 1.000.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 14/03/2024 | USD | 550.226,26 | 0,13 |
| 200.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.550% 28/03/2030 | USD | 105.377,05 | 0,02 |
| 250.000 | SRILANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024 | USD | 132.615,57 | 0,03 |
| | | | **1.323.807,32** | **0,31** |
| | **Südafrika** | | | |
| 200.000 | ESKOM HOLDINGS SOC LTD 7.125% 11/02/2025 | USD | 179.749,52 | 0,04 |
| 500.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.850% 30/09/2029 | USD | 443.619,50 | 0,11 |
| 400.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 12/10/2046 | USD | 305.558,65 | 0,07 |
| 290.000 | REPUBLIC OF SOUTH AFRICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 30/09/2049 | USD | 238.143,32 | 0,05 |
| | | | **1.167.070,99** | **0,27** |
| | **Indien** | | | |
| 250.000 | ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% 08/09/2024 | USD | 216.164,11 | 0,05 |
| 550.000 | HDFC BANK LTD FRN PERP | USD | 473.436,46 | 0,11 |
| 300.000 | JSW HYDRO ENERGY LTD 4.125% 18/05/2031 | USD | 257.783,35 | 0,06 |
| 200.000 | JSW STEEL LTD 5.050% 05/04/2032 | USD | 171.773,41 | 0,04 |
| | | | **1.119.157,33** | **0,26** |
| | **Kolumbien** | | | |
| 240.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.250% 22/04/2032 | USD | 193.361,97 | 0,04 |
| 300.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 15/02/2061 | USD | 209.470,59 | 0,05 |
| 200.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 15/05/2051 | USD | 149.291,84 | 0,03 |
| 240.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.125% 22/02/2042 | USD | 186.373,83 | 0,04 |
| 400.000 | COLOMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 18/01/2041 | USD | 379.473,33 | 0,10 |
| | | | **1.117.971,56** | **0,26** |
| | **Mauritius** | | | |
| 200.000 | GREENKO INVESTMENT CO 4.875% 16/08/2023 | USD | 173.479,63 | 0,04 |
| 535.000 | HTA GROUP LTD 7.000% 18/12/2025 | USD | 485.174,89 | 0,11 |
| 500.000 | UPL CORP LTD 4.625% 16/06/2030 | USD | 458.223,79 | 0,11 |
| | | | **1.116.878,31** | **0,26** |
| | **Georgien** | | | |
| 500.000 | SILKNET JSC 11.000% 02/04/2024 | USD | 467.457,85 | 0,11 |
| 600.000 | TBC BANK JSC 5.750% 19/06/2024 EMTN | USD | 553.821,40 | 0,13 |
| | | | **1.021.279,25** | **0,24** |
| | **Paraguay** | | | |
| 260.000 | BANCO CONTINENTAL SAECA 2.750% 10/12/2025 | USD | 223.077,32 | 0,04 |
| 205.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 28/04/2031 | USD | 199.728,21 | 0,05 |
| 203.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.739% 29/01/2033 | USD | 168.210,41 | 0,04 |
| 200.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.600% 13/03/2048 | USD | 199.954,86 | 0,05 |
| 200.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.100% 11/08/2044 | USD | 210.250,28 | 0,05 |
| | | | **1.001.221,08** | **0,23** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Guatemela** | | | |
| 200.000 | GUATEMALA GOVERNMENT BOND 4.375% 05/06/2027 | USD | 183.994,33 | 0,04 |
| 205.000 | GUATEMALA GOVERNMENT BOND 5.375% 24/04/2032 | USD | 196.992,92 | 0,05 |
| 400.000 | GUATEMALA GOVERNMENT BOND 6.125% 01/06/2050 | USD | 397.606,33 | 0,09 |
| | | | **778.593,58** | **0,18** |
| | **Malaysia** | | | |
| 200.000 | PETRONAS CAPITAL LTD 3.500% 21/04/2030 EMTN | USD | 187.329,98 | 0,04 |
| 365.000 | PETRONAS CAPITAL LTD 4.550% 21/04/2050 EMTN | USD | 384.994,77 | 0,09 |
| 200.000 | SSG RESOURCES LTD 4.250% 04/10/2022 | USD | 177.257,46 | 0,04 |
| | | | **749.582,21** | **0,17** |
| | **Insel Man** | | | |
| 275.000 | ANGLOGOLD ASHANTI HOLDINGS PLC 6.500% 15/04/2040 | USD | 291.039,27 | 0,07 |
| 500.000 | GOHL CAPITAL LTD 4.250% 24/01/2027 | USD | 454.060,28 | 0,10 |
| | | | **745.099,55** | **0,17** |
| | **Bahamas** | | | |
| 200.000 | BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 21/11/2028 | USD | 148.359,77 | 0,03 |
| 315.000 | BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 15/10/2032 | USD | 255.489,88 | 0,06 |
| 305.000 | INTERCORP PERU LTD 3.875% 15/08/2029 | USD | 258.073,21 | 0,06 |
| | | | **661.922,86** | **0,15** |
| | **China** | | | |
| 350.000 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 24/06/2030 FRN | USD | 306.607,73 | 0,07 |
| 400.000 | CHINA MINMETALS CORP FRN PERP | USD | 352.311,42 | 0,08 |
| | | | **658.919,15** | **0,15** |
| | **Elfenbeinküste** | | | |
| 170.000 | IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 30/01/2032 | EUR | 165.781,32 | 0,04 |
| 300.000 | IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 15/06/2033 | USD | 273.257,50 | 0,06 |
| 200.000 | IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 22/03/2048 | EUR | 201.250,00 | 0,05 |
| | | | **640.288,82** | **0,15** |
| | **Israel** | | | |
| 700.000 | ENERGEAN ISRAEL FINANCE LTD 4.500% 30/03/2024 | USD | 616.347,61 | 0,14 |
| | | | **616.347,61** | **0,14** |
| | **Kenia** | | | |
| 265.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.300% 23/01/2034 | USD | 225.767,07 | 0,05 |
| 400.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.000% 22/05/2032 | USD | 381.632,32 | 0,09 |
| | | | **607.399,39** | **0,14** |
| | **Marokko** | | | |
| 200.000 | MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.375% 15/12/2027 | USD | 169.075,48 | 0,04 |
| 248.000 | MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.000% 15/12/2032 | USD | 203.368,62 | 0,05 |
| 271.000 | MOROCCO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.000% 15/12/2050 | USD | 213.772,89 | 0,05 |
| | | | **586.216,99** | **0,14** |
| | **Angola** | | | |
| 600.000 | ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 08/05/2048 | USD | 534.527,35 | 0,12 |
| | | | **534.527,35** | **0,12** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Pakistan** | | | |
| 400.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 05/12/2027 | USD | 347.578,36 | 0,08 |
| 200.000 | THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUKUK CO LTD/THE 5.625% 05/12/2022 | USD | 176.466,69 | 0,04 |
| | | | **524.045,05** | **0,12** |
| | **Ecuador** | | | |
| 36.522 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 31/07/2030 | USD | 16.759,10 | 0,00 |
| 204.300 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 31/07/2040 STEP-UP | USD | 103.815,13 | 0,02 |
| 445.770 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 31/07/2035 STEP-UP | USD | 253.644,83 | 0,07 |
| 170.100 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 31/07/2030 STEP-UP | USD | 123.507,58 | 0,03 |
| 16.733 | PETROAMAZONAS EP 4.625% 06/11/2020 | USD | 14.360,27 | 0,00 |
| | | | **512.086,91** | **0,12** |
| | **Kuwait** | | | |
| 500.000 | AL AHLI BANK OF KUWAIT KSCP FRN PERP | USD | 458.383,88 | 0,11 |
| | | | **458.383,88** | **0,11** |
| | **Trinidad und Tobago** | | | |
| 300.000 | TELECOMMUNICATIONS SERVICES OF TRINIDAD & TOBAGO LTD 8.875% 18/10/2029 | USD | 277.108,09 | 0,07 |
| 200.000 | TRINIDAD & TOBAGO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.375% 16/01/2024 | USD | 181.082,38 | 0,04 |
| | | | **458.190,47** | **0,11** |
| | **Irak** | | | |
| 520.000 | IRAQ INTERNATIONAL BOND 6.752% 09/03/2023 | USD | 455.508,27 | 0,11 |
| | | | **455.508,27** | **0,11** |
| | **Weißrussland** | | | |
| 200.000 | REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 5.875% 24/02/2026 | USD | 162.233,14 | 0,04 |
| 320.000 | REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 6.378% 24/02/2031 | USD | 243.054,15 | 0,05 |
| | | | **405.287,29** | **0,09** |
| | **Kasachstan** | | | |
| 200.000 | KAZMUNAYGAS NATIONAL CO JSC 5.750% 19/04/2047 | USD | 208.343,68 | 0,05 |
| 200.000 | KAZTRANSGAS JSC 4.375% 26/09/2027 | USD | 190.458,85 | 0,04 |
| | | | **398.802,53** | **0,09** |
| | **Tunesien** | | | |
| 315.000 | BANQUE CENTRALE DE TUNISIE INTERNATIONAL BOND 5.625% 17/02/2024 | EUR | 266.962,27 | 0,06 |
| 125.000 | BANQUE CENTRALE DE TUNISIE INTERNATIONAL BOND 6.750% 31/10/2023 | EUR | 109.249,64 | 0,03 |
| | | | **376.211,91** | **0,09** |
| | **Papua-Neuguinea** | | | |
| 400.000 | PAPUA NEW GUINEA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.375% 04/10/2028 | USD | 346.292,37 | 0,08 |
| | | | **346.292,37** | **0,08** |
| | **Senegal** | | | |
| 174.000 | SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 08/06/2037 | EUR | 171.793,17 | 0,04 |
| 200.000 | SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 13/03/2048 | USD | 174.364,85 | 0,04 |
| | | | **346.158,02** | **0,08** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Uruguay** | | | |
| 280.000 | URUGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.100% 18/06/2050 | USD | 307.800,35 | 0,07 |
| | | | **307.800,35** | **0,07** |
| | **Montenegro** | | | |
| 315.000 | MONTENEGRO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 16/12/2027 | EUR | 296.297,05 | 0,07 |
| | | | **296.297,05** | **0,07** |
| | **Armenien** | | | |
| 343.000 | REPUBLIC OF ARMENIA INTERNATIONAL BOND 3.600% 02/02/2031 | USD | 280.421,19 | 0,06 |
| | | | **280.421,19** | **0,06** |
| | **Jamaika** | | | |
| 200.000 | JAMAICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 28/07/2045 | USD | 240.039,35 | 0,06 |
| | | | **240.039,35** | **0,06** |
| | **Republik Serbien** | | | |
| 290.000 | SERBIA INTERNATIONAL BOND 2.125% 01/12/2030 | USD | 234.317,91 | 0,05 |
| | | | **234.317,91** | **0,05** |
| | **Benin** | | | |
| 110.000 | BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 19/01/2032 | EUR | 109.689,24 | 0,03 |
| 100.000 | BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 19/01/2052 | EUR | 103.005,83 | 0,02 |
| | | | **212.695,07** | **0,05** |
| | **El Salvador** | | | |
| 285.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 18/01/2027 | USD | 183.475,10 | 0,04 |
| | | | **183.475,10** | **0,04** |
| | **Singapur** | | | |
| 200.000 | GLOBAL PRIME CAPITAL PTE LTD 5.950% 23/01/2025 | USD | 178.060,08 | 0,04 |
| | | | **178.060,08** | **0,04** |
| | | | **401.717.966,10** | **92,77** |

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Anleihen und andere Schuldtitel

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | **Jungferninseln** | | | |
| 733.198 | OAS RESTRUCTURING BVI LTD 5.000% 31/03/2035 | USD | 0,00 | 0,00 |
| | | | **0,00** | **0,00** |
| | | | **0,00** | **0,00** |

### Organismen für gemeinsame Anlagen

#### Offene Fonds

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| | **Luxemburg** | | | |
| 2.774 | NN (L) FIRST CLASS STABLE YIELD OPPORTUNITIES - Z CAP EUR | EUR | 15.256.056,84 | 3,52 |
| 4.661 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 4.617.805,27 | 1,07 |
| | | | **19.873.862,11** | **4,59** |
| | | | **19.873.862,11** | **4,59** |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **421.591.828,21** | **97,36** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 33.676.364,94 | USD | 28.392.877,60 | EUR | 19/10/2021 | 28.392.877,60 | 656.201,44 |
| 199.412.760,00 | CZK | 7.846.608,08 | EUR | 19/10/2021 | 7.846.608,08 | 15.402,20 |
| 3.413.206,61 | AUD | 2.121.264,47 | EUR | 19/10/2021 | 2.121.264,47 | 5.624,94 |
| 1.133.000,00 | USD | 971.468,50 | EUR | 31/12/2021 | 971.468,50 | 4.133,70 |
| 8.632.827,38 | EUR | 7.430.000,00 | GBP | 31/12/2021 | 8.632.827,38 | 4.108,50 |
| 169.325,47 | EUR | 2.896.275,99 | ZAR | 19/10/2021 | 169.325,47 | 3.622,64 |
| 370.000,00 | CAD | 249.931,44 | EUR | 31/12/2021 | 249.931,44 | 1.574,72 |
| 58.644,19 | USD | 50.237,02 | EUR | 01/10/2021 | 50.237,02 | 364,12 |
| 47.938,92 | AUD | 29.717,58 | EUR | 01/10/2021 | 29.717,58 | 161,78 |
| 27.322,13 | ZAR | 1.550,28 | EUR | 01/10/2021 | 1.550,28 | 16,68 |
| 1.455,43 | USD | 1.246,78 | EUR | 04/10/2021 | 1.246,78 | 9,04 |
| 8.085,03 | CZK | 317,08 | EUR | 04/10/2021 | 317,08 | 1,94 |
| 2.618,26 | EUR | 4.223,65 | AUD | 01/10/2021 | 2.618,26 | (14,26) |
| 2.331,30 | EUR | 59.475,00 | CZK | 01/10/2021 | 2.331,30 | (15,50) |
| 3.404,44 | EUR | 60.000,00 | ZAR | 01/10/2021 | 3.404,44 | (36,64) |
| 20.902,28 | EUR | 531.803,12 | CZK | 19/10/2021 | 20.902,28 | (64,49) |
| 27.278,44 | EUR | 31.769,02 | USD | 04/10/2021 | 27.278,44 | (133,46) |
| 18.816,49 | EUR | 21.965,43 | USD | 01/10/2021 | 18.816,49 | (136,38) |
| 15.536,17 | EUR | 273.893,33 | ZAR | 04/10/2021 | 15.536,17 | (171,96) |
| 67.579,34 | EUR | 109.000,00 | AUD | 31/12/2021 | 67.579,34 | (253,09) |
| 94.644,98 | EUR | 152.331,17 | AUD | 19/10/2021 | 94.644,98 | (277,94) |
| 38.175,31 | EUR | 176.980,74 | PLN | 04/10/2021 | 38.175,31 | (278,03) |
| 35.934,87 | EUR | 643.000,00 | ZAR | 31/12/2021 | 35.934,87 | (409,97) |
| 580.459,27 | EUR | 685.396,27 | USD | 19/10/2021 | 580.459,27 | (10.760,43) |
| 96.840.944,88 | ZAR | 5.648.227,05 | EUR | 19/10/2021 | 5.648.227,05 | (107.726,59) |
| 163.151.877,86 | PLN | 36.168.943,88 | EUR | 19/10/2021 | 36.168.943,88 | (731.520,38) |
| 267.245.650,79 | EUR | 312.874.761,67 | USD | 31/12/2021 | 267.245.650,79 | (2.164.150,08) |
| | | | | | **358.437.874,55** | **(2.324.727,50)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) First Class Yield Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| 122 | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 16.461.460,00 | (97.600,00) |
| 38 | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 6.453.160,00 | (89.287,98) |
| (1) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 203.340,00 | 6.820,00 |
| (103) | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 11.557.115,00 | 8.755,00 |
| 35 | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 4.808.366,41 | (133.539,52) |
| 52 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 8.572.630,40 | (325.294,45) |
| (189) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 21.462.679,04 | 254.217,18 |
| 203 | US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 38.544.459,78 | (21.894,73) |
| | | | **108.063.210,63** | **(397.824,50)** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR |
|---|---|---|---|
| | **Optionsschein** | | |
| 219.520 | OAS FINANCE LTD 21/01/2039 | USD | 0,00 |
| | | | **0,00** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | **(2.722.552,00)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **421.591.828,21** | **97,36** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(2.722.552,00)** | **(0,63)** |
| **Bankguthaben** | **1.724.506,28** | **0,40** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **12.429.734,36** | **2,87** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **433.023.516,85** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Food & Beverages

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 188.673.434,63 |
| | 30.09.2020 | USD | 240.285.547,36 |
| | 30.09.2019 | USD | 314.388.792,02 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 18.524,93 |
| | 30.09.2020 | EUR | 17.432,93 |
| | 30.09.2019 | EUR | 17.845,25 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 3.032,36 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.887,27 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.748,18 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.367,10 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.020,64 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.968,28 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 248,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.582,64 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.483,70 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.387,65 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 714,13 |
| | 30.09.2020 | EUR | 687,46 |
| | 30.09.2019 | EUR | 689,48 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 291,52 |
| | 30.09.2020 | USD | 278,25 |
| | 30.09.2019 | USD | 265,48 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 285,37 |
| | 30.09.2020 | EUR | 272,74 |
| | 30.09.2019 | EUR | 271,46 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.302,07 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.198,86 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.284,96 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.333,54 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.254,95 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.178,17 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 361,84 |
| | 30.09.2020 | USD | 353,23 |
| | 30.09.2019 | USD | 344,71 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 10.347,70 |
| | 30.09.2019 | USD | 9.942,77 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 248,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 10.018,31 |
| | 30.09.2020 | USD | 9.634,49 |
| | 30.09.2019 | USD | 9.302,84 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.785,08 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.680,15 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.699,81 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 281,93 |
| | 30.09.2020 | USD | 270,77 |
| | 30.09.2019 | USD | 261,27 |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 275,83 |
| | 30.09.2020 | EUR | 264,89 |
| | 30.09.2019 | EUR | 266,92 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 242,07 |
| | 30.09.2020 | USD | 238,63 |
| | 30.09.2019 | USD | 235,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 241,84 |
| | 30.09.2020 | AUD | 237,76 |
| | 30.09.2019 | AUD | 245,19 |

| **Anzahl der Anteile** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 145 |
| | 30.09.2020 | 132 |
| | 30.09.2019 | 753 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 891 |
| | 30.09.2020 | 922 |
| | 30.09.2019 | 4.916 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1.020 |
| | 30.09.2020 | 1.268 |
| | 30.09.2019 | 1.563 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 40 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 20.768 |
| | 30.09.2020 | 24.960 |
| | 30.09.2019 | 25.984 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 40.825 |
| | 30.09.2020 | 49.980 |
| | 30.09.2019 | 56.612 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 5.016 |
| | 30.09.2020 | 6.122 |
| | 30.09.2019 | 8.853 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 7.365 |
| | 30.09.2020 | 9.604 |
| | 30.09.2019 | 8.742 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Food & Beverages

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 5.581 |
| | 30.09.2020 | 7.737 |
| | 30.09.2019 | 8.526 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 14.014 |
| | 30.09.2020 | 15.566 |
| | 30.09.2019 | 12.368 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 21.638 |
| | 30.09.2020 | 26.678 |
| | 30.09.2019 | 6.632 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 1.910 |
| | 30.09.2019 | 8.124 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 40 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1.632 |
| | 30.09.2020 | 2.011 |
| | 30.09.2019 | 2.081 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 2.270 |
| | 30.09.2020 | 2.921 |
| | 30.09.2019 | 3.185 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1.609 |
| | 30.09.2020 | 2.288 |
| | 30.09.2019 | 2.644 |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 3.733 |
| | 30.09.2020 | 5.359 |
| | 30.09.2019 | 7.293 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 5.042 |
| | 30.09.2020 | 5.825 |
| | 30.09.2019 | 5.739 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | 4.752 |
| | 30.09.2020 | 5.603 |
| | 30.09.2019 | 4.075 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 1,70 |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 1,60 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 08.04.2021 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 06.10.2020 | USD | 0,40 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 08.04.2021 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,42 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 06.10.2020 | AUD | 0,42 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Food & Beverages

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| **Laufende Kosten in %*** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,07% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 3,30% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,07% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | 2,32% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 60,48% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Food & Beverages

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **187.264.004,84** |
| Aktien | | 187.264.004,84 |
| **Bankguthaben** | | **1.610.087,50** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **1.762.905,44** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***190.636.997,78*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(1.253.986,40)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(709.576,75)** |
| Devisentermingeschäfte | | (709.576,75) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(1.963.563,15)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***188.673.434,63*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **4.665.819,48** |
| Dividenden | | 4.665.819,48 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(3.859.183,89)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (3.166.126,63) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (584.909,25) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (12.781,85) |
| Abonnementsteuer | 9 | (93.871,12) |
| Bankzinsen | | (1.495,04) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **806.635,59** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 21.029.621,79 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (6.813.895,66) |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (679.890,91) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 952.595,65 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.037.232,35) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (7.697.198,18) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 237.771,55 |
| **Ergebnis** | | **6.798.407,48** |
| Zeichnungen | | 87.539.082,63 |
| Rücknahmen | | (145.889.103,40) |
| Ausschüttung | | (60.499,44) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 240.285.547,36 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***188.673.434,63*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Food & Beverages

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 64.667 | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | USD | 3.880.666,67 | 2,06 |
| 36.600 | BROWN-FORMAN CORP - B | USD | 2.452.566,00 | 1,30 |
| 47.500 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 1.985.975,00 | 1,05 |
| 170.032 | COCA-COLA CO | USD | 8.921.579,04 | 4,73 |
| 65.498 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 4.950.338,84 | 2,62 |
| 8.662 | CONSTELLATION BRANDS INC - A | USD | 1.824.996,78 | 0,97 |
| 37.130 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 16.684.365,50 | 8,84 |
| 14.000 | ESTEE LAUDER COS INC/THE - A | USD | 4.199.020,00 | 2,23 |
| 103.296 | GENERAL MILLS INC | USD | 6.179.166,72 | 3,28 |
| 3.400 | HERSHEY CO/THE | USD | 575.450,00 | 0,30 |
| 31.600 | HORMEL FOODS CORP | USD | 1.295.600,00 | 0,69 |
| 21.640 | KIMBERLY-CLARK CORP | USD | 2.866.001,60 | 1,52 |
| 11.600 | KRAFT HEINZ CO/THE | USD | 427.112,00 | 0,23 |
| 51.597 | KROGER CO/THE | USD | 2.086.066,71 | 1,11 |
| 2.100 | LAMB WESTON HOLDINGS INC | USD | 128.877,00 | 0,07 |
| 45.870 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A | USD | 2.668.716,60 | 1,41 |
| 114.155 | PEPSICO INC | USD | 17.170.053,55 | 9,10 |
| 83.115 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | USD | 11.619.477,00 | 6,16 |
| 56.979 | SYSCO CORP | USD | 4.472.851,50 | 2,37 |
| 12.300 | TYSON FOODS INC - A | USD | 970.962,00 | 0,51 |
| 20.910 | WALMART INC | USD | 2.914.435,80 | 1,54 |
| | | | **98.274.278,31** | **52,09** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 14.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | USD | 774.060,00 | 0,41 |
| 21.919 | DIAGEO PLC | GBP | 1.065.734,64 | 0,56 |
| 15.200 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | GBP | 1.194.853,79 | 0,63 |
| 1.762.152 | TESCO PLC | GBP | 6.018.401,84 | 3,18 |
| 236.820 | UNILEVER PLC | EUR | 12.802.304,92 | 6,79 |
| | | | **21.855.355,19** | **11,57** |
| **Schweiz** | | | | |
| 1.053 | BARRY CALLEBAUT AG - REG | CHF | 2.393.053,55 | 1,27 |
| 134.611 | NESTLE SA - REG | CHF | 16.262.700,01 | 8,62 |
| | | | **18.655.753,56** | **9,89** |
| **Japan** | | | | |
| 26.800 | AJINOMOTO CO INC | JPY | 791.727,85 | 0,42 |
| 23.400 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD | JPY | 1.133.531,37 | 0,60 |
| 11.000 | FANCL CORP | JPY | 364.182,59 | 0,19 |
| 7.800 | KIKKOMAN CORP | JPY | 633.573,16 | 0,34 |
| 1.900 | KOSE CORP | JPY | 227.168,44 | 0,12 |
| 7.100 | POLA ORBIS HOLDINGS INC | JPY | 163.560,92 | 0,09 |
| 33.900 | SHISEIDO CO LTD | JPY | 2.283.160,78 | 1,21 |
| 13.200 | SUNDRUG CO LTD | JPY | 402.222,71 | 0,21 |
| 152.000 | UNICHARM CORP | JPY | 6.722.012,62 | 3,56 |
| | | | **12.721.140,44** | **6,74** |
| **Frankreich** | | | | |
| 74.800 | CARREFOUR SA | EUR | 1.347.587,63 | 0,72 |
| 7.030 | L'OREAL SA | EUR | 2.907.406,24 | 1,54 |
| 31.540 | PERNOD RICARD SA | EUR | 6.970.710,95 | 3,69 |
| | | | **11.225.704,82** | **5,95** |
| **Dänemark** | | | | |
| 29.312 | CARLSBERG AS - B | DKK | 4.794.648,46 | 2,54 |
| | | | **4.794.648,46** | **2,54** |
| **Irland** | | | | |
| 34.699 | KERRY GROUP PLC | EUR | 4.664.871,02 | 2,47 |
| | | | **4.664.871,02** | **2,47** |
| **Niederlande** | | | | |
| 7.100 | DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | EUR | 100.223,68 | 0,05 |
| 11.500 | HEINEKEN NV | EUR | 1.202.178,81 | 0,64 |
| 14.100 | JDE PEET'S NV | EUR | 421.602,82 | 0,22 |
| 68.900 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 2.294.537,27 | 1,22 |
| | | | **4.018.542,58** | **2,13** |
| **Kanada** | | | | |
| 20.278 | ALIMENTATION COUCHE-TARD INC - B | CAD | 775.681,32 | 0,41 |
| 84.500 | EMPIRE CO LTD - A | CAD | 2.574.653,67 | 1,37 |
| | | | **3.350.334,99** | **1,78** |
| **Australien** | | | | |
| 108.700 | WOOLWORTHS GROUP LTD | AUD | 3.080.541,87 | 1,63 |
| | | | **3.080.541,87** | **1,63** |
| **Deutschland** | | | | |
| 22.645 | HENKEL AG & CO KGAA | EUR | 1.956.521,68 | 1,04 |
| | | | **1.956.521,68** | **1,04** |
| **Belgien** | | | | |
| 17.100 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | EUR | 973.957,81 | 0,52 |
| | | | **973.957,81** | **0,52** |
| **Schweden** | | | | |
| 12.431 | AXFOOD AB | SEK | 297.967,17 | 0,16 |
| 12.200 | ESSITY AB - B | SEK | 379.308,57 | 0,20 |
| | | | **677.275,74** | **0,36** |
| **Norwegen** | | | | |
| 22.300 | MOWI ASA | NOK | 567.383,22 | 0,30 |
| | | | **567.383,22** | **0,30** |
| **Spanien** | | | | |
| 4.300 | VISCOFAN SA | EUR | 281.816,07 | 0,15 |
| | | | **281.816,07** | **0,15** |
| **Färöer-Inseln** | | | | |
| 2.000 | BAKKAFROST P/F | NOK | 165.879,08 | 0,09 |
| | | | **165.879,08** | **0,09** |
| | | | **187.264.004,84** | **99,25** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **187.264.004,84** | **99,25** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Food & Beverages

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | Zu zahlen | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | |
| 337.795,23 CAD | 225.312,20 EUR | 19/10/2021 | 265.502,09 | 5.432,34 |
| 278.034,31 USD | 235.230,33 EUR | 19/10/2021 | 278.034,31 | 5.333,53 |
| 2.083.393,41 EUR | 1.788.149,99 GBP | 19/10/2021 | 2.459.948,06 | 4.164,41 |
| 130.930,17 USD | 179.355,04 AUD | 19/10/2021 | 130.930,17 | 1.364,78 |
| 865.446,80 AUD | 538.708,96 EUR | 19/10/2021 | 634.773,63 | 674,12 |
| 1.341.982,05 EUR | 9.975.654,43 DKK | 19/10/2021 | 1.584.142,68 | 538,02 |
| 16.757.726,00 JPY | 129.170,53 EUR | 19/10/2021 | 150.955,00 | 461,88 |
| 222.635,33 CHF | 205.633,55 EUR | 19/10/2021 | 239.727,93 | 364,13 |
| 62.698,60 AUD | 33.423,68 GBP | 19/10/2021 | 45.857,64 | 225,55 |
| 135.609,46 AUD | 91.225,94 CHF | 19/10/2021 | 99.167,82 | 133,27 |
| 40.817,60 AUD | 188.316,13 DKK | 19/10/2021 | 29.822,49 | 127,86 |
| 9.782,95 CAD | 10.520,92 AUD | 19/10/2021 | 7.704,01 | 121,80 |
| 53.979,26 EUR | 90.659,84 NZD | 19/10/2021 | 63.719,81 | 40,97 |
| 80.952,39 SEK | 7.963,13 EUR | 19/10/2021 | 9.425,92 | 22,67 |
| 17.433,97 NOK | 1.714,10 EUR | 19/10/2021 | 1.999,25 | 9,82 |
| 2.001,18 AUD | 2.085,89 NZD | 19/10/2021 | 1.462,56 | 6,80 |
| 1.674.246,00 JPY | 20.772,11 AUD | 19/10/2021 | 15.117,60 | 1,46 |
| 22,76 AUD | 53,57 ILS | 19/10/2021 | 16,63 | (0,17) |
| 68,45 AUD | 67,70 SGD | 19/10/2021 | 50,03 | (0,42) |
| 9.215,31 SEK | 1.459,21 AUD | 19/10/2021 | 1.053,70 | (0,66) |
| 97,43 AUD | 556,97 HKD | 19/10/2021 | 71,21 | (1,17) |
| 8.333,13 NOK | 1.327,80 AUD | 19/10/2021 | 962,38 | (4,69) |
| 5.675,12 AUD | 35.932,06 SEK | 19/10/2021 | 4.147,66 | (7,98) |
| 1.329.143,40 DKK | 178.750,38 EUR | 19/10/2021 | 211.204,53 | (9,56) |
| 51.633,29 DKK | 11.156,33 AUD | 19/10/2021 | 8.174,71 | (9,62) |
| 777,30 EUR | 2.948,23 ILS | 19/10/2021 | 917,56 | (12,81) |
| 2.081,02 NZD | 2.008,12 AUD | 19/10/2021 | 1.475,13 | (15,18) |
| 1.628,65 EUR | 2.595,42 SGD | 19/10/2021 | 1.922,54 | (23,63) |
| 5.882,60 GBP | 11.020,79 AUD | 19/10/2021 | 8.020,25 | (29,42) |
| 1.268,64 EUR | 11.686,65 HKD | 19/10/2021 | 1.497,57 | (30,60) |
| 14.693,31 CHF | 21.865,91 AUD | 19/10/2021 | 15.891,27 | (38,78) |
| 6.179,37 AUD | 39.392,15 NOK | 19/10/2021 | 4.516,19 | (48,19) |
| 30.902,64 AUD | 28.586,43 CAD | 19/10/2021 | 22.585,19 | (240,45) |
| 99.168,99 AUD | 8.025.328,00 JPY | 19/10/2021 | 72.514,87 | (295,94) |
| 90.372,46 NZD | 54.404,52 EUR | 19/10/2021 | 64.057,64 | (732,20) |
| 178.397,38 EUR | 1.820.090,12 SEK | 19/10/2021 | 210.589,18 | (1.253,24) |
| 195.568,51 EUR | 2.008.915,44 NOK | 19/10/2021 | 230.858,85 | (3.388,56) |
| 1.156.503,64 EUR | 1.863.458,10 AUD | 19/10/2021 | 1.365.030,79 | (5.428,87) |
| 795.342,36 AUD | 584.821,73 USD | 19/10/2021 | 584.821,73 | (10.269,46) |
| 4.741.173,02 EUR | 5.137.788,01 CHF | 19/10/2021 | 5.597.154,80 | (13.344,54) |
| 1.037.764,82 EUR | 1.546.871,60 CAD | 19/10/2021 | 1.225.029,47 | (17.933,78) |
| 3.251.230,70 EUR | 423.944.122,00 JPY | 19/10/2021 | 3.839.125,12 | (30.906,50) |
| 25.430.148,29 EUR | 30.125.556,46 USD | 19/10/2021 | 30.125.556,46 | (644.573,74) |
| | | | **49.615.536,43** | **(709.576,75)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(709.576,75)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **187.264.004,84** | **99,25** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(709.576,75)** | **(0,38)** |
| **Bankguthaben** | **1.610.087,50** | **0,85** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **508.919,04** | **0,28** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **188.673.434,63** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 352.298.071,67 |
| | 30.09.2020 | USD | 303.128.293,37 |
| | 30.09.2019 | USD | 390.672.585,94 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 8.111,80 |
| | 30.09.2020 | USD | 7.316,31 |
| | 30.09.2019 | USD | 7.489,40 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.395,21 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.829,31 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.126,90 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 31,87 |
| | 30.09.2020 | EUR | 29,06 |
| | 30.09.2019 | EUR | 30,55 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 366,35 |
| | 30.09.2020 | USD | 332,46 |
| | 30.09.2019 | USD | 342,46 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 311,51 |
| | 30.09.2020 | EUR | 285,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 302,07 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 294,93 |
| | 30.09.2020 | USD | 268,45 |
| | 30.09.2019 | USD | 277,31 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 307,78 |
| | 30.09.2020 | EUR | 283,16 |
| | 30.09.2019 | EUR | 300,33 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 262,37 |
| | 30.09.2019 | USD | 274,74 |
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.859,86 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.721,81 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.011,70 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 244,88 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 220,23 |
| | 30.09.2020 | EUR | 214,06 |
| | 30.09.2019 | EUR | 239,00 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 226,88 |
| | 30.09.2020 | USD | 225,73 |
| | 30.09.2019 | USD | 255,05 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 348,49 |
| | 30.09.2020 | AUD | 349,78 |
| | 30.09.2019 | AUD | 404,40 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 3.497,37 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 3.521,75 |
| | 30.09.2019 | ZAR | 4.073,64 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 219,38 |
| | 30.09.2020 | USD | 221,01 |
| | 30.09.2019 | USD | 252,55 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 334,61 |
| | 30.09.2020 | AUD | 340,22 |
| | 30.09.2019 | AUD | 398,49 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 3.358,77 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 3.435,07 |
| | 30.09.2019 | ZAR | 4.023,12 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 32.346 |
| | 30.09.2020 | 30.307 |
| | 30.09.2019 | 41.178 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 3.932 |
| | 30.09.2020 | 4.129 |
| | 30.09.2019 | 6.085 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 9.438 |
| | 30.09.2020 | 14.834 |
| | 30.09.2019 | 18.372 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 2.545 |
| | 30.09.2020 | 5.153 |
| | 30.09.2019 | 2.303 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 5.956 |
| | 30.09.2020 | 7.288 |
| | 30.09.2019 | 15.863 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 8.617 |
| | 30.09.2020 | 6.815 |
| | 30.09.2019 | 723 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 17.441 |
| | 30.09.2020 | 22.767 |
| | 30.09.2019 | 23.744 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 0,65 |
| | 30.09.2019 | 0,65 |
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 5.050 |
| | 30.09.2020 | 3.600 |
| | 30.09.2019 | 2.079 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 8 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 41.630 |
| | 30.09.2020 | 45.442 |
| | 30.09.2019 | 49.423 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 22.886 |
| | 30.09.2020 | 22.310 |
| | 30.09.2019 | 2.219 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1.429 |
| | 30.09.2020 | 1.549 |
| | 30.09.2019 | 570 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 8.062 |
| | 30.09.2020 | 6.445 |
| | 30.09.2019 | 1.589 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 3.482 |
| | 30.09.2020 | 3.190 |
| | 30.09.2019 | 6.090 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 344 |
| | 30.09.2020 | 341 |
| | 30.09.2019 | 96 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 5.524 |
| | 30.09.2020 | 984 |
| | 30.09.2019 | 295 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 317,05 |
| Distribution X Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 12,40 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,74 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 2,77 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 43,10 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,74 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution Y (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,74 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 2,77 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 43,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 43,10 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,92% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,50% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,52% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,48% |
| Distribution X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,80% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 2,82% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 2,82% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 19,76% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **332.000.615,84** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 332.000.615,84 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **907.434,59** |
| Credit Default Swaps | | 256.476,51 |
| Futures | | 650.958,08 |
| **Bankguthaben** | | **11.925.454,21** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **1.019.805,15** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **22.485.506,00** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***368.338.815,79*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(14.402.546,20)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(1.638.197,92)** |
| Devisentermingeschäfte | | (1.638.197,92) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(16.040.744,12)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***352.298.071,67*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **22.853.584,13** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 22.798.005,88 |
| Bankzinsen | | 16.419,40 |
| Sonstige Erträge | 10 | 39.158,85 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(3.509.179,88)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.793.060,87) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (576.105,08) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (17.210,10) |
| Abonnementsteuer | 9 | (49.316,71) |
| Bankzinsen | | (11.057,96) |
| Zinsen auf Swaps | | (62.429,16) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **19.344.404,25** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 2.875.545,22 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.329.382,71) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 5.162.417,16 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (4.544.227,16) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 221.963,78 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (304.652,06) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 9.737.481,14 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 465.924,38 |
| **Ergebnis** | | **31.629.474,00** |
| Zeichnungen | | 68.618.685,74 |
| Rücknahmen | | (47.669.178,44) |
| Ausschüttung | | (3.409.203,00) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 303.128.293,37 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***352.298.071,67*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Nigeria** | | | |
| 1.555.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 28/09/2028 EMTN | USD | 1.560.229,51 | 0,44 |
| 5.100.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 28/11/2027 EMTN | USD | 5.277.450,52 | 1,50 |
| 1.785.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 28/09/2033 EMTN | USD | 1.798.994,61 | 0,51 |
| 1.950.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/11/2025 | USD | 2.156.110,13 | 0,61 |
| 4.155.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 28/11/2047 EMTN | USD | 4.007.881,46 | 1,14 |
| 9.400.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.696% 23/02/2038 | USD | 9.299.796,47 | 2,65 |
| 300.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 16/02/2032 | USD | 311.678,14 | 0,09 |
| 2.815.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/09/2051 EMTN | USD | 2.835.126,35 | 0,80 |
| 3.160.000 | NIGERIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.248% 21/01/2049 | USD | 3.427.525,19 | 0,97 |
| | | | **30.674.792,38** | **8,71** |
| | **Ghana** | | | |
| 1.210.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 07/04/2025 | USD | 933.450,29 | 0,26 |
| 3.570.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.375% 11/02/2027 | USD | 3.367.654,15 | 0,96 |
| 1.970.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 11/02/2035 | USD | 1.763.749,12 | 0,50 |
| 250.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 26/03/2027 | USD | 244.818,49 | 0,07 |
| 1.620.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 18/01/2026 | USD | 1.640.402,99 | 0,47 |
| 3.780.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.125% 26/03/2032 | USD | 3.585.111,89 | 1,02 |
| 1.720.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.625% 07/04/2034 | USD | 1.638.412,30 | 0,47 |
| 8.920.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.627% 16/06/2049 | USD | 7.968.140,56 | 2,25 |
| 3.070.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 11/03/2061 | USD | 2.734.043,97 | 0,78 |
| 2.440.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 07/05/2042 | USD | 2.269.092,25 | 0,64 |
| 4.225.000 | GHANA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 26/03/2051 | USD | 3.842.741,31 | 1,09 |
| | | | **29.987.617,32** | **8,51** |
| | **Sri Lanka** | | | |
| 3.635.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 03/06/2025 | USD | 2.291.537,88 | 0,65 |
| 5.875.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.200% 11/05/2027 | USD | 3.588.875,47 | 1,02 |
| 2.500.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.350% 28/06/2024 | USD | 1.600.372,00 | 0,45 |
| 5.290.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 18/04/2028 | USD | 3.231.641,37 | 0,92 |
| 13.890.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 03/11/2025 | USD | 8.753.740,38 | 2,49 |
| 1.300.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.850% 14/03/2024 | USD | 828.990,14 | 0,24 |
| 1.850.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.550% 28/03/2030 | USD | 1.129.672,23 | 0,32 |
| 4.450.000 | SRI LANKA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.850% 14/03/2029 | USD | 2.716.598,89 | 0,77 |
| 1.400.000 | SRILANKAN AIRLINES LTD 7.000% 25/06/2024 | USD | 860.690,92 | 0,24 |
| | | | **25.002.119,28** | **7,10** |
| | **Pakistan** | | | |
| 2.525.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.000% 08/04/2026 EMTN | USD | 2.512.562,91 | 0,71 |
| 6.900.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 05/12/2027 | USD | 6.948.747,47 | 1,98 |
| 2.500.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 08/04/2031 EMTN | USD | 2.494.758,75 | 0,71 |
| 3.270.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 31/03/2036 | USD | 3.209.080,75 | 0,91 |
| 1.600.000 | PAKISTAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 08/04/2051 EMTN | USD | 1.610.649,44 | 0,46 |
| 300.000 | PAKISTAN WATER & POWER DEVELOPMENT AUTHORITY 7.500% 04/06/2031 | USD | 297.266,75 | 0,08 |
| 1.350.000 | THIRD PAKISTAN INTERNATIONAL SUKUK CO LTD/THE 5.625% 05/12/2022 | USD | 1.380.483,47 | 0,39 |
| | | | **18.453.549,54** | **5,24** |
| | **Angola** | | | |
| 1.180.000 | ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.000% 26/11/2029 EMTN | USD | 1.210.783,97 | 0,34 |
| 3.870.000 | ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 09/05/2028 | USD | 4.019.747,91 | 1,14 |
| 7.805.000 | ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.125% 26/11/2049 EMTN | USD | 7.925.892,19 | 2,25 |
| 4.420.000 | ANGOLAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 08/05/2048 | USD | 4.563.579,77 | 1,30 |
| | | | **17.720.003,84** | **5,03** |
| | **Jamaika** | | | |
| 9.510.000 | JAMAICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.875% 28/07/2045 | USD | 13.228.106,06 | 3,75 |
| | | | **13.228.106,06** | **3,75** |
| | **Jordanien** | | | |
| 1.790.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 07/07/2025 | USD | 1.867.180,90 | 0,53 |
| 200.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 31/01/2027 | USD | 213.643,84 | 0,06 |
| 3.890.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.850% 07/07/2030 | USD | 4.037.036,13 | 1,15 |
| 5.905.000 | JORDAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 10/10/2047 | USD | 6.118.903,66 | 1,73 |
| | | | **12.236.764,53** | **3,47** |
| | **Costa Rica** | | | |
| 408.955 | AUTOPISTAS DEL SOL SA/COSTA RICA 7.375% 30/12/2030 | USD | 426.893,66 | 0,12 |
| 700.000 | COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 30/04/2043 | USD | 619.862,74 | 0,18 |
| 500.000 | COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.125% 19/02/2031 | USD | 513.215,05 | 0,15 |
| 1.500.000 | COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 04/04/2044 | USD | 1.481.199,17 | 0,42 |
| 4.135.000 | COSTA RICA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.158% 12/03/2045 | USD | 4.143.606,96 | 1,18 |
| 5.830.000 | INSTITUTO COSTARRICENSE DE ELECTRICIDAD 6.375% 15/05/2043 | USD | 5.040.072,84 | 1,42 |
| | | | **12.224.850,42** | **3,47** |
| | **Kenia** | | | |
| 3.160.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.300% 23/01/2034 | USD | 3.120.085,53 | 0,89 |
| 400.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.250% 28/02/2028 | USD | 440.307,41 | 0,12 |
| 1.430.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.000% 22/05/2032 | USD | 1.581.196,67 | 0,45 |
| 6.355.000 | REPUBLIC OF KENYA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 28/02/2048 | USD | 6.876.035,52 | 1,95 |
| | | | **12.017.625,13** | **3,41** |
| | **Aserbaidschan** | | | |
| 4.670.000 | REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 3.500% 01/09/2032 | USD | 4.759.523,48 | 1,35 |
| 500.000 | REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 4.750% 18/03/2024 | USD | 534.764,90 | 0,15 |
| 5.000.000 | REPUBLIC OF AZERBAIJAN INTERNATIONAL BOND 5.125% 01/09/2029 | USD | 5.580.253,20 | 1,59 |
| 400.000 | SOUTHERN GAS CORRIDOR CJSC 6.875% 24/03/2026 | USD | 471.437,86 | 0,13 |
| | | | **11.345.979,44** | **3,22** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **El Salvador** | | | |
| 900.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2025 | USD | 688.606,73 | 0,20 |
| 240.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.124% 20/01/2050 | USD | 165.336,80 | 0,05 |
| 5.010.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.125% 20/01/2050 | USD | 3.451.405,68 | 0,98 |
| 6.055.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 01/02/2041 | USD | 4.249.171,09 | 1,20 |
| 1.309.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.625% 21/09/2034 | USD | 945.971,99 | 0,27 |
| 500.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.650% 15/06/2035 | USD | 364.545,66 | 0,10 |
| 1.700.000 | EL SALVADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.500% 15/07/2052 | USD | 1.324.113,05 | 0,38 |
| | | | **11.189.151,00** | **3,18** |
| | **Paraguay** | | | |
| 575.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 28/04/2031 | USD | 649.259,18 | 0,18 |
| 819.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.739% 29/01/2033 | USD | 786.512,11 | 0,22 |
| 5.235.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.400% 30/03/2050 | USD | 6.003.197,30 | 1,71 |
| 1.440.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.600% 13/03/2048 | USD | 1.668.511,37 | 0,48 |
| 1.365.000 | PARAGUAY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.100% 11/08/2044 | USD | 1.663.044,77 | 0,47 |
| | | | **10.770.524,73** | **3,06** |
| | **Irak** | | | |
| 9.559.875 | IRAQ INTERNATIONAL BOND 5.800% 15/01/2028 | USD | 9.222.961,96 | 2,62 |
| | | | **9.222.961,96** | **2,62** |
| | **Guatemela** | | | |
| 700.000 | GUATEMALA GOVERNMENT BOND 4.375% 05/06/2027 | USD | 746.340,81 | 0,21 |
| 420.000 | GUATEMALA GOVERNMENT BOND 5.375% 24/04/2032 | USD | 467.746,72 | 0,13 |
| 6.785.000 | GUATEMALA GOVERNMENT BOND 6.125% 01/06/2050 | USD | 7.816.419,33 | 2,22 |
| | | | **9.030.506,86** | **2,56** |
| | **Weißrussland** | | | |
| 2.485.000 | DEVELOPMENT BANK OF THE REPUBLIC OF BELARUS JSC 6.750% 02/05/2024 | USD | 2.339.438,86 | 0,66 |
| 200.000 | REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 6.378% 24/02/2031 | USD | 176.054,75 | 0,05 |
| 5.570.000 | REPUBLIC OF BELARUS INTERNATIONAL BOND 7.625% 29/06/2027 | USD | 5.507.061,40 | 1,57 |
| | | | **8.022.555,01** | **2,28** |
| | **Sambia** | | | |
| 8.650.000 | ZAMBIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.970% 30/07/2027 | USD | 6.666.237,72 | 1,89 |
| | | | **6.666.237,72** | **1,89** |
| | **Ägypten** | | | |
| 619.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.875% 16/02/2026 | USD | 582.001,63 | 0,17 |
| 640.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 06/10/2025 | USD | 652.172,41 | 0,19 |
| 595.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.750% 29/05/2024 | USD | 620.112,22 | 0,18 |
| 1.570.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.800% 30/09/2027 EMTN | USD | 1.541.179,86 | 0,43 |
| 1.151.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.500% 16/02/2061 | USD | 1.010.541,67 | 0,29 |
| 379.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.700% 01/03/2049 | USD | 367.605,03 | 0,10 |
| 1.130.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.750% 30/09/2051 EMTN | USD | 1.105.173,91 | 0,31 |
| 745.000 | EGYPT GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.875% 29/05/2050 | USD | 737.284,31 | 0,21 |
| | | | **6.616.071,04** | **1,88** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Bahrain** | | | |
| 1.125.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.250% 25/01/2028 EMTN | USD | 1.109.736,33 | 0,31 |
| 1.688.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.250% 25/01/2033 EMTN | USD | 1.606.252,62 | 0,46 |
| 2.009.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 25/01/2051 EMTN | USD | 1.846.676,78 | 0,53 |
| 555.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 20/09/2029 | USD | 595.795,95 | 0,17 |
| 830.000 | BAHRAIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.375% 14/05/2030 | USD | 920.187,38 | 0,26 |
| | | | **6.078.649,06** | **1,73** |
| | **Senegal** | | | |
| 1.381.000 | SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.375% 08/06/2037 | EUR | 1.580.210,76 | 0,45 |
| 4.300.000 | SENEGAL GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 13/03/2048 | USD | 4.344.723,10 | 1,23 |
| | | | **5.924.933,86** | **1,68** |
| | **Ukraine** | | | |
| 900.000 | STATE AGENCY OF ROADS OF UKRAINE 6.250% 24/06/2028 | USD | 889.130,77 | 0,25 |
| 3.350.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 31/05/2040 FRN | USD | 3.642.698,85 | 1,04 |
| 500.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 20/06/2026 | EUR | 628.968,78 | 0,18 |
| 365.000 | UKRAINE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.876% 21/05/2029 | USD | 369.614,66 | 0,10 |
| | | | **5.530.413,06** | **1,57** |
| | **Papua-Neuguinea** | | | |
| 5.370.000 | PAPUA NEW GUINEA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.375% 04/10/2028 | USD | 5.387.929,68 | 1,53 |
| | | | **5.387.929,68** | **1,53** |
| | **Gabun** | | | |
| 4.730.000 | GABON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.950% 16/06/2025 | USD | 5.120.800,88 | 1,45 |
| | | | **5.120.800,88** | **1,45** |
| | **Elfenbeinküste** | | | |
| 1.035.000 | IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 30/01/2032 | EUR | 1.169.746,36 | 0,33 |
| 2.005.000 | IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.625% 22/03/2048 | EUR | 2.338.217,80 | 0,67 |
| 1.235.000 | IVORY COAST GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 17/10/2040 | EUR | 1.529.233,19 | 0,43 |
| | | | **5.037.197,35** | **1,43** |
| | **Honduras** | | | |
| 1.200.000 | HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.625% 24/06/2030 | USD | 1.253.550,22 | 0,36 |
| 3.429.000 | HONDURAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 19/01/2027 | USD | 3.723.274,76 | 1,05 |
| | | | **4.976.824,98** | **1,41** |
| | **Peru** | | | |
| 495.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.862% 01/12/2032 | USD | 451.723,87 | 0,13 |
| 2.660.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.780% 01/12/2060 | USD | 2.249.163,96 | 0,63 |
| 2.400.000 | PERUVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.230% 28/07/2121 | USD | 1.995.726,00 | 0,57 |
| | | | **4.696.613,83** | **1,33** |
| | **Ecuador** | | | |
| 225.815 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND ZCP 31/07/2030 | USD | 120.091,90 | 0,03 |
| 2.300.000 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 31/07/2040 STEP-UP | USD | 1.354.518,23 | 0,39 |
| 1.733.550 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 31/07/2035 STEP-UP | USD | 1.143.184,28 | 0,33 |
| 661.500 | ECUADOR GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 5.000% 31/07/2030 STEP-UP | USD | 556.652,08 | 0,16 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 50.200 | PETROAMAZONAS EP 4.625% 06/11/2020 | USD | 49.928,49 | 0,01 |
| | | | **3.224.374,98** | **0,92** |
| | **Benin** | | | |
| 865.000 | BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 19/01/2032 | EUR | 999.659,64 | 0,28 |
| 1.457.000 | BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.950% 22/01/2035 | EUR | 1.646.320,75 | 0,47 |
| 458.000 | BENIN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.875% 19/01/2052 | EUR | 546.753,98 | 0,16 |
| | | | **3.192.734,37** | **0,91** |
| | **Mosambik** | | | |
| 3.700.000 | MOZAMBIQUE INTERNATIONAL BOND 5.000% 15/09/2031 STEP-UP | USD | 3.184.233,32 | 0,90 |
| | | | **3.184.233,32** | **0,90** |
| | **Tunesien** | | | |
| 300.000.000 | BANQUE CENTRALE DE TUNISIE INTERNATIONAL BOND 3.500% 03/02/2033 | JPY | 1.504.753,48 | 0,43 |
| 200.000 | BANQUE CENTRALE DE TUNISIE INTERNATIONAL BOND 5.625% 17/02/2024 | EUR | 196.441,85 | 0,06 |
| 1.600.000 | BANQUE CENTRALE DE TUNISIE INTERNATIONAL BOND 5.750% 30/01/2025 | USD | 1.349.649,42 | 0,38 |
| | | | **3.050.844,75** | **0,87** |
| | **Dominikanische Republik** | | | |
| 350.000 | BANCO DE RESERVAS DE LA REPUBLICA DOMINICANA 7.000% 01/02/2023 | USD | 367.197,54 | 0,10 |
| 782.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 4.500% 30/01/2030 | USD | 795.991,43 | 0,23 |
| 800.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.300% 21/01/2041 | USD | 792.862,58 | 0,23 |
| 1.090.000 | DOMINICAN REPUBLIC INTERNATIONAL BOND 5.875% 30/01/2060 | USD | 1.069.133,26 | 0,30 |
| | | | **3.025.184,81** | **0,86** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 1.603.262 | BIOCEANICO SOVEREIGN CERTIFICATE LTD ZCP 05/06/2034 | USD | 1.202.174,45 | 0,34 |
| 437.000 | MALDIVES SUKUK ISSUANCE LTD 9.875% 08/04/2026 | USD | 442.099,13 | 0,13 |
| 1.181.000 | SA GLOBAL SUKUK LTD 0.946% 17/06/2024 | USD | 1.169.850,04 | 0,33 |
| | | | **2.814.123,62** | **0,80** |
| | **Armenien** | | | |
| 2.713.000 | REPUBLIC OF ARMENIA INTERNATIONAL BOND 3.600% 02/02/2031 | USD | 2.570.580,44 | 0,73 |
| | | | **2.570.580,44** | **0,73** |
| | **Oman** | | | |
| 210.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.875% 01/02/2025 EMTN | USD | 218.203,25 | 0,06 |
| 675.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.250% 25/01/2031 | USD | 720.841,33 | 0,21 |
| 300.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.750% 17/01/2048 | USD | 296.475,72 | 0,08 |
| 460.000 | OMAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.000% 25/01/2051 | USD | 467.075,72 | 0,13 |
| 240.000 | OQ SAOC 5.125% 06/05/2028 | USD | 243.160,12 | 0,07 |
| | | | **1.945.756,14** | **0,55** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.100.000 | TULLOW OIL PLC 7.000% 01/03/2025 | USD | 956.109,06 | 0,28 |
| 364.000 | UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 7.875% 15/07/2026 | USD | 368.870,39 | 0,10 |
| 580.000 | UKRAINE RAILWAYS VIA RAIL CAPITAL MARKETS PLC 8.250% 09/07/2024 | USD | 604.766,21 | 0,17 |
| | | | **1.929.745,66** | **0,55** |
| | **Indonesien** | | | |
| 200.000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 4.750% 15/05/2025 | USD | 218.010,42 | 0,06 |
| 200.000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 5.450% 15/05/2030 | USD | 230.292,17 | 0,07 |
| 200.000 | INDONESIA ASAHAN ALUMINIUM PERSERO PT 5.800% 15/05/2050 | USD | 233.916,96 | 0,07 |
| 1.300.000 | PERUSAHAAN PERSEROAN PERSERO PT PERUSAHAAN LISTRIK NEGARA 4.000% 30/06/2050 | USD | 1.246.367,58 | 0,35 |
| | | | **1.928.587,13** | **0,55** |
| | **Mexiko** | | | |
| 300.000 | PETROLEOS MEXICANOS 5.500% 27/06/2044 | USD | 240.360,80 | 0,07 |
| 300.000 | PETROLEOS MEXICANOS 5.625% 23/01/2046 | USD | 241.242,05 | 0,07 |
| 1.210.000 | PETROLEOS MEXICANOS 6.875% 16/10/2025 | USD | 1.326.033,36 | 0,37 |
| | | | **1.807.636,21** | **0,51** |
| | **Tadschikistan** | | | |
| 1.980.000 | REPUBLIC OF TAJIKISTAN INTERNATIONAL BOND 7.125% 14/09/2027 | USD | 1.777.741,95 | 0,50 |
| | | | **1.777.741,95** | **0,50** |
| | **Türkei** | | | |
| 600.000 | ISTANBUL METROPOLITAN MUNICIPALITY 6.375% 09/12/2025 | USD | 591.508,64 | 0,17 |
| 610.000 | PEGASUS HAVA TASIMACILIGI AS 9.250% 30/04/2026 | USD | 643.960,08 | 0,18 |
| 505.000 | TURKEY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 20/09/2033 | USD | 485.090,47 | 0,14 |
| | | | **1.720.559,19** | **0,49** |
| | **Argentinien** | | | |
| 40.353 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.500% 09/07/2029 | EUR | 18.205,47 | 0,01 |
| 635.350 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.750% 09/07/2035 STEP-UP | EUR | 235.554,79 | 0,07 |
| 12.731 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.000% 09/07/2029 | USD | 4.888,13 | 0,00 |
| 3.600.000 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.125% 09/07/2035 STEP-UP | USD | 1.175.400,32 | 0,33 |
| 500.000 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.500% 09/07/2041 STEP-UP | EUR | 196.559,26 | 0,06 |
| 7.700.000 | ARGENTINE REPUBLIC GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 15/12/2035 FRN | USD | 38.444,71 | 0,00 |
| | | | **1.669.052,68** | **0,47** |
| | **Bahamas** | | | |
| 1.775.000 | BAHAMAS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.950% 15/10/2032 | USD | 1.668.500,00 | 0,47 |
| | | | **1.668.500,00** | **0,47** |
| | **Montenegro** | | | |
| 1.225.000 | MONTENEGRO GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.875% 16/12/2027 | EUR | 1.335.419,01 | 0,38 |
| | | | **1.335.419,01** | **0,38** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 460.000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 2.634% 17/05/2026 | USD | 470.218,36 | 0,14 |
| 690.000 | AFRICAN EXPORT-IMPORT BANK/THE 3.798% 17/05/2031 | USD | 715.525,49 | 0,21 |
| | | | **1.185.743,85** | **0,35** |
| | **Uzbekistan** | | | |
| 1.158.000 | REPUBLIC OF UZBEKISTAN INTERNATIONAL BOND 3.900% 19/10/2031 | USD | 1.130.791,82 | 0,32 |
| | | | **1.130.791,82** | **0,32** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Barbados** | | | |
| 1.016.400 | BARBADOS GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.500% 01/10/2029 | USD | 1.024.920,35 | 0,29 |
| | | | **1.024.920,35** | **0,29** |
| | **Rumänien** | | | |
| 846.000 | ROMANIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 2.750% 14/04/2041 EMTN | EUR | 910.840,55 | 0,26 |
| | | | **910.840,55** | **0,26** |
| | **Bolivien** | | | |
| 1.000.000 | BOLIVIAN GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.500% 20/03/2028 | USD | 908.416,26 | 0,26 |
| | | | **908.416,26** | **0,26** |
| | **Irland** | | | |
| 537.614 | SADEREA DAC 12.500% 30/11/2026 EMTN | USD | 581.237,96 | 0,16 |
| | | | **581.237,96** | **0,16** |
| | **Venezuela** | | | |
| 4.225.000 | VENEZUELA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 9.375% 13/01/2034 - DEFAULTED | USD | 453.724,82 | 0,13 |
| | | | **453.724,82** | **0,13** |
| | **Libanon** | | | |
| 200.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 6.650% 22/04/2024 | USD | 33.409,20 | 0,01 |
| 2.000.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 7.250% 23/03/2037 | USD | 360.558,62 | 0,10 |
| 200.000 | LEBANON GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 8.250% 12/04/2021 EMTN | USD | 34.055,72 | 0,01 |
| | | | **428.023,54** | **0,12** |
| | **Mazedonien** | | | |
| 375.000 | NORTH MACEDONIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.625% 10/03/2028 | EUR | 424.339,74 | 0,12 |
| | | | **424.339,74** | **0,12** |
| | **Mongolei** | | | |
| 200.000 | MONGOLIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 3.500% 07/07/2027 | USD | 194.069,20 | 0,05 |
| 200.000 | MONGOLIA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 4.450% 07/07/2031 | USD | 194.021,39 | 0,06 |
| | | | **388.090,59** | **0,11** |
| | **Marokko** | | | |
| 257.000 | OCP SA 5.125% 23/06/2051 | USD | 254.388,96 | 0,07 |
| | | | **254.388,96** | **0,07** |
| | **Georgien** | | | |
| 246.000 | GEORGIAN RAILWAY JSC 4.000% 17/06/2028 | USD | 250.207,76 | 0,07 |
| | | | **250.207,76** | **0,07** |
| | **Bosnien** | | | |
| 99.792 | BOSNIA & HERZEGOVINA GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.250% 20/12/2021 | DEM | 52.036,42 | 0,01 |
| | | | **52.036,42** | **0,01** |
| | | | **332.000.615,84** | **94,24** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **332.000.615,84** | **94,24** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swap** | | | | | | |
| CDX EMERGING MARKETS SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 6.450.000,00 | 256.476,51 |
| | | | | | | **256.476,51** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 16.332.852,52 | USD | 13.820.000,00 | EUR | 29/10/2021 | 16.332.852,52 | 308.363,59 |
| 1.632.137,68 | USD | 179.000.000,00 | JPY | 29/10/2021 | 1.632.137,68 | 27.553,96 |
| 784.406,60 | USD | 11.412.381,88 | ZAR | 19/10/2021 | 784.406,60 | 27.470,28 |
| 795.724,28 | USD | 680.887,88 | EUR | 19/10/2021 | 795.724,28 | 6.376,00 |
| 23.899,73 | USD | 32.609,49 | AUD | 19/10/2021 | 23.899,73 | 342,76 |
| 33.872,97 | ZAR | 2.231,79 | USD | 04/10/2021 | 2.231,79 | 19,65 |
| 23.955,53 | ZAR | 1.586,72 | USD | 01/10/2021 | 1.586,72 | 5,54 |
| 172,71 | USD | 147,95 | EUR | 01/10/2021 | 172,71 | 1,24 |
| 217,10 | USD | 300,00 | AUD | 01/10/2021 | 217,10 | 0,40 |
| 111,26 | USD | 95,79 | EUR | 04/10/2021 | 111,26 | 0,24 |
| 4.664,46 | EUR | 5.445,06 | USD | 01/10/2021 | 5.445,06 | (39,18) |
| 6.000.000,00 | JPY | 54.200,80 | USD | 29/10/2021 | 54.200,80 | (415,88) |
| 647.617,18 | AUD | 477.514,13 | USD | 19/10/2021 | 477.514,13 | (9.677,97) |
| 1.170.000,00 | EUR | 1.373.075,60 | USD | 29/10/2021 | 1.373.075,60 | (16.443,75) |
| 58.250.786,52 | ZAR | 3.999.295,19 | USD | 19/10/2021 | 3.999.295,19 | (135.760,27) |
| 67.816.668,37 | EUR | 80.465.356,30 | USD | 19/10/2021 | 80.465.356,30 | (1.845.994,53) |
| | | | | | **105.948.227,47** | **(1.638.197,92)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| (14) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 2.189.279,69 | 12.238,51 |
| (14) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 2.755.380,40 | 43.436,01 |
| (9) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 2.120.948,00 | 70.510,89 |
| (155) | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 24.678.906,25 | 456.523,44 |
| (20) | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 3.821.250,00 | 101.475,72 |
| (47) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 6.185.640,63 | 60.585,94 |
| 158 | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 19.393.265,70 | (93.812,43) |
| | | | **61.144.670,67** | **650.958,08** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(730.763,33)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)

*(ausgedrückt in USD)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **332.000.615,84** | **94,24** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(730.763,33)** | **(0,21)** |
| **Bankguthaben** | **11.925.454,21** | **3,39** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **9.102.764,95** | **2,58** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **352.298.071,67** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Bond Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 60.444.945,35 |
| | 30.09.2020 | EUR | 65.144.281,05 |
| | 30.09.2019 | EUR | 100.579.270,94 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 19.137,49 |
| | 30.09.2020 | EUR | 18.174,27 |
| | 30.09.2019 | EUR | 18.861,57 |
| Capitalisation I Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.689,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.533,54 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.559,21 |
| Capitalisation I Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 20.352,04 |
| | 30.09.2020 | PLN | 19.579,90 |
| | 30.09.2019 | PLN | 19.461,95 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 909,17 |
| | 30.09.2020 | EUR | 867,38 |
| | 30.09.2019 | EUR | 904,32 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.008,07 |
| | 30.09.2020 | USD | 973,10 |
| | 30.09.2019 | USD | 943,22 |
| Capitalisation P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 220,90 |
| | 30.09.2020 | EUR | 214,44 |
| | 30.09.2019 | EUR | 216,74 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 922,55 |
| | 30.09.2020 | EUR | 876,69 |
| | 30.09.2019 | EUR | 910,12 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.022,52 |
| | 30.09.2020 | USD | 983,22 |
| | 30.09.2019 | USD | 949,30 |
| Capitalisation R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 224,26 |
| | 30.09.2020 | EUR | 216,83 |
| | 30.09.2019 | EUR | 218,11 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 883,22 |
| | 30.09.2020 | EUR | 844,73 |
| | 30.09.2019 | EUR | 882,89 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 979,00 |
| | 30.09.2020 | USD | 947,39 |
| | 30.09.2019 | USD | 920,56 |
| Capitalisation X Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 215,08 |
| | 30.09.2020 | EUR | 209,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | 211,92 |
| Distribution N Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 21,88 |
| | 30.09.2020 | EUR | 21,35 |
| | 30.09.2019 | EUR | 21,72 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 244,86 |
| | 30.09.2020 | EUR | 234,75 |
| | 30.09.2019 | EUR | 246,55 |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 297,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | 290,43 |
| | 30.09.2019 | EUR | 295,37 |
| Distribution P (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 548,46 |
| | 30.09.2020 | USD | 530,40 |
| | 30.09.2019 | USD | 518,03 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 245,48 |
| | 30.09.2020 | EUR | 235,31 |
| | 30.09.2019 | EUR | 247,19 |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 298,36 |
| | 30.09.2020 | EUR | 291,04 |
| | 30.09.2019 | EUR | 296,06 |
| Distribution R (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 550,19 |
| | 30.09.2020 | USD | 531,99 |
| | 30.09.2019 | USD | 519,63 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 94,16 |
| | 30.09.2020 | USD | 91,21 |
| | 30.09.2019 | USD | 89,26 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 520 |
| | 30.09.2020 | 520 |
| | 30.09.2019 | 580 |
| Capitalisation I Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 154 |
| | 30.09.2020 | 214 |
| | 30.09.2019 | 468 |
| Capitalisation I Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | 2.285 |
| | 30.09.2020 | 2.094 |
| | 30.09.2019 | 5.630 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 3.765 |
| | 30.09.2020 | 4.798 |
| | 30.09.2019 | 5.528 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 3.874 |
| | 30.09.2020 | 4.878 |
| | 30.09.2019 | 5.085 |
| Capitalisation P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 61.319 |
| | 30.09.2020 | 62.255 |
| | 30.09.2019 | 96.590 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 175 |
| | 30.09.2020 | 362 |
| | 30.09.2019 | 2.188 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Bond Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 252 |
| | 30.09.2020 | 287 |
| | 30.09.2019 | 366 |
| Capitalisation R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 303 |
| | 30.09.2020 | 303 |
| | 30.09.2019 | 528 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 864 |
| | 30.09.2020 | 1.367 |
| | 30.09.2019 | 1.769 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2.102 |
| | 30.09.2020 | 3.454 |
| | 30.09.2019 | 5.971 |
| Capitalisation X Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 3.629 |
| | 30.09.2020 | 4.936 |
| | 30.09.2019 | 8.040 |
| Distribution N Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 2.180 |
| | 30.09.2020 | 2.789 |
| | 30.09.2019 | 2.757 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 6.688 |
| | 30.09.2020 | 8.004 |
| | 30.09.2019 | 8.650 |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 37.197 |
| | 30.09.2020 | 44.897 |
| | 30.09.2019 | 50.217 |
| Distribution P (Q) (USD) | 30.09.2021 | 4.373 |
| | 30.09.2020 | 5.413 |
| | 30.09.2019 | 6.408 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 947 |
| | 30.09.2020 | 2.039 |
| | 30.09.2019 | 2.119 |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 224 |
| | 30.09.2020 | 389 |
| | 30.09.2019 | 717 |
| Distribution R (Q) (USD) | 30.09.2021 | 260 |
| | 30.09.2020 | 341 |
| | 30.09.2019 | 365 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 3.695 |
| | 30.09.2020 | 4.521 |
| | 30.09.2019 | 4.748 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution N Hedged (iii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,20 |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 1,15 |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 1,35 |
| Distribution P (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 0,05 |
| Distribution P (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 0,15 |
| Distribution P (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 0,30 |
| Distribution P (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 0,50 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 2,05 |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 2,50 |
| Distribution R (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 0,60 |
| Distribution R (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 0,65 |
| Distribution R (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 0,85 |
| Distribution R (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 1,00 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,01 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,01 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,01 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,02 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,02 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,02 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Capitalisation I Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,51% |
| Capitalisation I Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | 0,51% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,97% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 0,56% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Bond Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,58% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 1,20% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,20% |
| Capitalisation X Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,22% |
| Distribution N Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,57% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,97% |
| Distribution P (Q) (USD) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,58% |
| Distribution R (Q) (USD) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 1,20% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 79,81% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Bond Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **53.416.132,32** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 53.416.132,32 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **1.979.160,10** |
| Credit Default Swaps | | 1.508.424,40 |
| Zinsswaps | | 322.150,26 |
| Futures | | 148.585,44 |
| **Bankguthaben** | | **5.290.768,56** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **1.498.534,99** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **430.165,20** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***62.614.761,17*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(1.702.074,29)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(467.741,53)** |
| Devisentermingeschäfte | | (467.741,53) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(2.169.815,82)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***60.444.945,35*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **1.931.470,86** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 560.117,65 |
| Zinsen auf Swaps | | 1.365.785,04 |
| Sonstige Erträge | 10 | 5.568,17 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(623.584,03)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (400.122,79) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (88.561,83) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (7.914,31) |
| Abonnementsteuer | 9 | (23.078,04) |
| Bankzinsen | | (23.785,15) |
| Zinsen auf Swaps | | (80.121,91) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **1.307.886,83** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 4.464.019,04 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.049.778,40) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 27.674.078,28 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (30.267.346,49) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 3.316.715,90 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (3.586.270,87) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (386.487,35) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 866.240,69 |
| **Ergebnis** | | **2.339.057,63** |
| Zeichnungen | | 2.385.006,15 |
| Rücknahmen | | (9.345.231,31) |
| Ausschüttung | | (78.168,17) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 65.144.281,05 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***60.444.945,35*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Bond Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 300.000 | ABBVIE INC 4.050% 21/11/2039 | USD | 297.349,00 | 0,49 |
| 300.000 | AIR LEASE CORP 3.625% 01/04/2027 | USD | 278.268,78 | 0,46 |
| 300.000 | AMERICAN EXPRESS CO 2.650% 02/12/2022 | USD | 265.922,44 | 0,44 |
| 250.000 | AMERICAN TOWER CORP 3.950% 15/03/2029 | USD | 240.206,39 | 0,40 |
| 350.000 | AMGEN INC 3.200% 02/11/2027 | USD | 328.524,24 | 0,54 |
| 250.000 | AT&T INC 4.850% 01/03/2039 | USD | 258.489,52 | 0,43 |
| 250.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/10/2030 FRN | USD | 225.189,47 | 0,37 |
| 300.000 | BANK OF AMERICA CORP 29/04/2031 FRN | USD | 264.042,15 | 0,44 |
| 250.000 | BOARDWALK PIPELINES LP 4.450% 15/07/2027 | USD | 242.684,64 | 0,40 |
| 149.000 | BOOKING HOLDINGS INC 4.625% 13/04/2030 | USD | 152.895,09 | 0,25 |
| 100.000 | BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 4.050% 01/07/2030 | USD | 96.091,32 | 0,16 |
| 150.000 | BROADCOM INC 3.419% 15/04/2033 | USD | 134.128,68 | 0,22 |
| 350.000 | BROADCOM INC 5.000% 15/04/2030 | USD | 352.901,05 | 0,58 |
| 398.000 | BROWN & BROWN INC 4.200% 15/09/2024 | USD | 373.604,73 | 0,62 |
| 200.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 4.800% 01/03/2050 | USD | 194.387,63 | 0,32 |
| 400.000 | CITIGROUP INC 24/07/2028 FRN | USD | 379.557,29 | 0,63 |
| 200.000 | CITIGROUP INC 31/03/2031 FRN | USD | 199.194,07 | 0,33 |
| 190.000 | CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 3.250% 30/04/2030 | USD | 175.740,53 | 0,29 |
| 200.000 | CVS HEALTH CORP 1.300% 21/08/2027 | USD | 169.855,50 | 0,28 |
| 350.000 | DAE FUNDING LLC 3.375% 20/03/2028 | USD | 311.508,69 | 0,52 |
| 200.000 | DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.300% 01/10/2029 | USD | 208.682,40 | 0,35 |
| 250.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 3.125% 24/03/2031 | USD | 223.669,32 | 0,37 |
| 150.000 | EOG RESOURCES INC 4.375% 15/04/2030 | USD | 151.106,53 | 0,25 |
| 250.000 | FULTON FINANCIAL CORP 15/03/2030 FRN | USD | 219.621,18 | 0,36 |
| 280.000 | GENERAL MILLS INC 4.200% 17/04/2028 | USD | 274.737,07 | 0,45 |
| 200.000 | GENERAL MOTORS CO 5.000% 01/04/2035 | USD | 204.085,73 | 0,34 |
| 170.000 | GENERAL MOTORS CO 6.800% 01/10/2027 | USD | 183.225,70 | 0,30 |
| 300.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 27/01/2032 FRN | USD | 249.378,69 | 0,41 |
| 350.000 | JPMORGAN CHASE & CO 13/05/2031 FRN | USD | 314.474,83 | 0,52 |
| 100.000 | MORGAN STANLEY 22/07/2028 FRN | USD | 94.794,65 | 0,16 |
| 100.000 | MPLX LP 4.700% 15/04/2048 | USD | 99.437,36 | 0,16 |
| 250.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 5.550% 15/03/2026 | USD | 239.514,55 | 0,40 |
| 300.000 | ORACLE CORP 2.500% 01/04/2025 | USD | 270.833,78 | 0,45 |
| 250.000 | ORACLE CORP 3.600% 01/04/2050 | USD | 215.942,81 | 0,36 |
| 100.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 3.550% 15/12/2029 | USD | 90.748,85 | 0,15 |
| 250.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.900% 15/02/2045 | USD | 234.153,79 | 0,39 |
| 100.000 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC 01/10/2050 FRN | USD | 90.419,35 | 0,15 |
| 100.000 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC 3.935% 07/12/2049 | USD | 101.458,11 | 0,17 |
| 500.000 | SAMMONS FINANCIAL GROUP INC 4.450% 12/05/2027 | USD | 481.821,73 | 0,80 |
| 250.000 | T-MOBILE USA INC 3.000% 15/02/2041 | USD | 209.159,21 | 0,35 |
| 5.420.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE 0.125% 30/06/2022 | USD | 4.678.473,80 | 7,74 |
| 2.740.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE 0.250% 30/09/2025 | USD | 2.313.969,54 | 3,83 |
| 250.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.875% 08/02/2029 | USD | 242.103,73 | 0,40 |
| 150.000 | VMWARE INC 4.700% 15/05/2030 | USD | 152.542,01 | 0,25 |
| 122.000 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 4.100% 15/04/2050 | USD | 116.941,24 | 0,19 |
| | | | **16.601.837,17** | **27,47** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Deutschland** | | | | |
| 3.070.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/02/2031 | EUR | 3.140.761,81 | 5,20 |
| 3.113.430 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2026 | EUR | 3.203.725,11 | 5,30 |
| 6.100.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 1.500% 15/05/2023 | EUR | 6.320.870,45 | 10,45 |
| 10.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE 2.500% 04/07/2044 | EUR | 15.343,94 | 0,03 |
| | | | **12.680.701,31** | **20,98** |
| **Japan** | | | | |
| 164.650.000 | JAPAN GOVERNMENT THIRTY YEAR BOND 1.400% 20/12/2045 | JPY | 1.520.854,18 | 2,52 |
| 245.450.000 | JAPAN GOVERNMENT TWENTY YEAR BOND 0.600% 20/12/2036 | JPY | 1.989.714,77 | 3,29 |
| 500.000.000 | JAPAN GOVERNMENT TWO YEAR BOND 0.100% 01/12/2021 | JPY | 3.867.945,06 | 6,40 |
| | | | **7.378.514,01** | **12,21** |
| **China** | | | | |
| 20.000.000 | CHINA DEVELOPMENT BANK 3.090% 18/06/2030 | CNY | 2.626.341,67 | 4,34 |
| 3.700.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 2.940% 17/10/2024 | CNY | 499.183,42 | 0,83 |
| 2.600.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3.120% 05/12/2026 | CNY | 353.852,06 | 0,59 |
| 3.100.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3.130% 21/11/2029 | CNY | 419.727,82 | 0,69 |
| 2.400.000 | CHINA GOVERNMENT BOND 3.390% 16/03/2050 | CNY | 314.612,66 | 0,52 |
| | | | **4.213.717,63** | **6,97** |
| **Frankreich** | | | | |
| 563.697 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/05/2066 | EUR | 708.291,14 | 1,17 |
| 2.096.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.000% 25/05/2048 | EUR | 2.691.740,84 | 4,46 |
| | | | **3.400.031,98** | **5,63** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 200.000 | STANDARD CHARTERED PLC 21/05/2025 FRN | USD | 183.951,52 | 0,30 |
| 50.000 | UNITED KINGDOM GILT 2.250% 07/09/2023 | GBP | 60.382,18 | 0,10 |
| 830.000 | UNITED KINGDOM GILT 3.250% 22/01/2044 | GBP | 1.312.057,06 | 2,17 |
| 530.000 | UNITED KINGDOM GILT 4.250% 07/06/2032 | GBP | 816.813,36 | 1,35 |
| | | | **2.373.204,12** | **3,92** |
| **Italien** | | | | |
| 300.000 | ENI SPA 4.250% 09/05/2029 | USD | 294.398,67 | 0,49 |
| 807.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.500% 01/03/2026 | EUR | 966.180,06 | 1,60 |
| 470.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 4.750% 01/09/2044 | EUR | 750.371,19 | 1,24 |
| 150.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 5.000% 01/09/2040 | EUR | 237.023,05 | 0,39 |
| | | | **2.247.972,97** | **3,72** |
| **Kanada** | | | | |
| 285.000 | BROOKFIELD FINANCE INC 4.250% 02/06/2026 | USD | 274.988,08 | 0,45 |
| 120.000 | CANADIAN GOVERNMENT BOND 2.750% 01/06/2022 | CAD | 83.075,72 | 0,14 |
| 270.000 | CANADIAN GOVERNMENT BOND 4.000% 01/06/2041 | CAD | 249.091,04 | 0,41 |
| 570.000 | CANADIAN GOVERNMENT BOND 5.750% 01/06/2033 | CAD | 557.409,38 | 0,92 |
| 500.000 | TECK RESOURCES LTD 3.900% 15/07/2030 | USD | 468.566,00 | 0,78 |
| | | | **1.633.130,22** | **2,70** |
| **Spanien** | | | | |
| 751.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.600% 30/04/2025 | EUR | 806.023,58 | 1,34 |
| 130.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 5.150% 31/10/2044 | EUR | 237.133,28 | 0,39 |
| 210.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 5.750% 30/07/2032 | EUR | 327.722,76 | 0,54 |
| | | | **1.370.879,62** | **2,27** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Bond Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Österreich** | | | |
| 728.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 1.750% 20/10/2023 | EUR | 765.327,55 | 1,26 |
| 186.000 | AUSTRIA GOVERNMENT BOND 2.400% 23/05/2034 | EUR | 237.659,87 | 0,39 |
| | | | **1.002.987,42** | **1,65** |
| | **Belgien** | | | |
| 50.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 2.150% 22/06/2066 | EUR | 69.877,20 | 0,12 |
| 120.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 5.000% 28/03/2035 | EUR | 194.848,17 | 0,32 |
| | | | **264.725,37** | **0,44** |
| | **Schweiz** | | | |
| 200.000 | UBS GROUP AG 3.491% 23/05/2023 | USD | 175.892,69 | 0,29 |
| | | | **175.892,69** | **0,29** |
| | **Australien** | | | |
| 40.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 5.750% 15/07/2022 | AUD | 26.042,12 | 0,04 |
| 53.000 | SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031 | USD | 46.495,69 | 0,08 |
| | | | **72.537,81** | **0,12** |
| | | | **53.416.132,32** | **88,37** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **53.416.132,32** | **88,37** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeichnung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swaps** | | | | | | |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 36 VERSION 1 | Verkauf | 5,000 | 20/12/2026 | EUR | 2.050.000,00 | 241.985,24 |
| CDX ITRAXX EUROPE SERIES 36 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2026 | EUR | 8.427.000,00 | 220.044,22 |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 36 VERSION 1 | Verkauf | 5,000 | 20/12/2026 | EUR | 1.470.000,00 | 173.521,12 |
| CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 37 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 6.640.000,00 | 136.728,19 |
| CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 37 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 6.620.000,00 | 136.316,36 |
| CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 37 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 6.500.000,00 | 133.845,38 |
| CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 37 VERSION 1 | Verkauf | 5,000 | 20/12/2026 | USD | 1.610.000,00 | 129.296,62 |
| CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 37 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2026 | USD | 6.100.000,00 | 125.608,73 |
| CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 37 VERSION 1 | Verkauf | 5,000 | 20/12/2026 | USD | 1.330.000,00 | 106.810,25 |
| CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 37 VERSION 1 | Verkauf | 5,000 | 20/12/2026 | USD | 1.320.000,00 | 106.007,17 |
| CDX ITRAXX EUROPE SUBORDINATED FINANCIAL SERIES 36 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2026 | EUR | 360.000,00 | (1.738,88) |
| | | | | | | **1.508.424,40** |

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| **Zinsswaps** | | | | | |
| Floating | 1.016 | 24/12/2050 | USD | 8.590.000,00 | 1.439.269,97 |
| 0.484 | Floating | 14/01/2026 | EUR | 2.070.000,00 | 65.920,10 |
| Floating | 0.078 | 15/04/2031 | EUR | 11.476.000,00 | 65.586,95 |
| 0.106 | Floating | 21/10/2023 | EUR | 3.900.000,00 | 42.874,69 |
| 2.498 | Floating | 17/01/2037 | USD | 350.000,00 | 31.579,80 |
| 2.527 | Floating | 17/01/2047 | USD | 250.000,00 | 31.412,52 |
| 0.139 | Floating | 19/07/2029 | EUR | 1.000.000,00 | 9.221,14 |
| 0.738 | Floating | 24/12/2030 | USD | 23.570.000,00 | (1.363.714,91) |
| | | | | | **322.150,26** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 13.160.000,00 | CAD | 8.764.756,26 | EUR | 17/12/2021 | 8.764.756,26 | 183.893,04 |
| 9.960.000,00 | USD | 8.411.433,44 | EUR | 17/12/2021 | 8.411.433,44 | 168.634,27 |
| 2.964.371,48 | EUR | 13.510.000,00 | PLN | 17/12/2021 | 2.964.371,48 | 34.451,23 |
| 7.090.000,00 | AUD | 4.391.620,16 | EUR | 17/12/2021 | 4.391.620,16 | 21.956,22 |
| 3.630.706,81 | USD | 99.950.000,00 | TWD | 17/12/2021 | 3.065.957,45 | 21.366,45 |
| 889.506.000,00 | JPY | 6.855.210,28 | EUR | 17/12/2021 | 6.855.210,28 | 17.374,48 |
| 278.280.000,00 | RUB | 3.757.732,40 | USD | 17/12/2021 | 3.234.828,01 | 8.531,62 |
| 154.853.000,00 | NOK | 15.265.008,13 | EUR | 17/12/2021 | 15.265.008,13 | 6.841,81 |
| 175.370,44 | EUR | 790.565,89 | PLN | 19/10/2021 | 175.370,44 | 3.655,48 |
| 79.477,98 | EUR | 3.042.649,67 | THB | 19/10/2021 | 79.477,98 | 1.917,56 |
| 6.333.329,21 | EUR | 819.510.000,00 | JPY | 17/12/2021 | 6.333.329,21 | 1.554,12 |
| 1.343.115,36 | EUR | 1.153.768,33 | GBP | 19/10/2021 | 1.343.115,36 | 1.165,38 |
| 190.000,00 | SGD | 119.586,50 | EUR | 17/12/2021 | 119.586,50 | 956,20 |
| 249.710.000,00 | COP | 64.410,21 | USD | 17/12/2021 | 55.128,91 | 647,99 |
| 22.185,68 | EUR | 7.745.311,84 | HUF | 19/10/2021 | 22.185,68 | 641,99 |
| 12.130,47 | EUR | 10.980.434,00 | CLP | 20/10/2021 | 12.130,47 | 488,67 |
| 299.595,33 | EUR | 410.775.172,00 | KRW | 20/10/2021 | 299.595,33 | 292,14 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Bond Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | Zu zahlen | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| 18.657,39 USD | 15.827,77 EUR | 19/10/2021 | 15.827,77 | 266,01 |
| 62.225,54 EUR | 1.482.544,42 MXN | 19/10/2021 | 62.225,54 | 136,30 |
| 4.882.145,00 JPY | 37.636,81 EUR | 19/10/2021 | 37.636,81 | 111,42 |
| 135.862,15 PLN | 1.153.541,62 THB | 19/10/2021 | 30.059,95 | 104,94 |
| 135.570,24 USD | 880.000,00 CNY | 17/12/2021 | 114.482,55 | 97,64 |
| 20.635,93 PLN | 4.142.974,00 CLP | 20/10/2021 | 4.565,77 | 89,63 |
| 2.510.000,00 SEK | 247.262,71 EUR | 17/12/2021 | 247.262,71 | 83,27 |
| 12.577,38 CAD | 8.492,52 EUR | 19/10/2021 | 8.492,52 | 71,17 |
| 37.626,47 PLN | 2.913.368,40 HUF | 19/10/2021 | 8.324,98 | 69,09 |
| 8.869.190,00 KRW | 6.402,09 EUR | 20/10/2021 | 6.402,09 | 60,27 |
| 4.423,19 SGD | 2.775,20 EUR | 19/10/2021 | 2.775,20 | 35,13 |
| 45.958,92 EUR | 77.189,43 NZD | 19/10/2021 | 45.958,92 | 30,07 |
| 9.502,30 AUD | 5.897,20 EUR | 19/10/2021 | 5.897,20 | 24,02 |
| 3.282.648,00 KRW | 10.909,43 PLN | 20/10/2021 | 2.381,92 | 22,31 |
| 18.026,07 EUR | 89.210,38 RON | 19/10/2021 | 18.026,07 | 22,13 |
| 18.294,46 CNY | 2.419,87 EUR | 20/10/2021 | 2.419,87 | 21,71 |
| 62.346,28 EUR | 463.492,22 DKK | 19/10/2021 | 62.346,28 | 16,19 |
| 5.787,20 CHF | 5.337,50 EUR | 19/10/2021 | 5.337,50 | 15,92 |
| 18.139,78 SEK | 1.779,49 EUR | 19/10/2021 | 1.779,49 | 9,26 |
| 49.632,29 GBP | 57.720,52 EUR | 19/10/2021 | 57.720,52 | 6,89 |
| 5.505,69 MYR | 1.127,07 EUR | 21/10/2021 | 1.127,07 | 6,24 |
| 10.286,68 NOK | 1.011,25 EUR | 19/10/2021 | 1.011,25 | 5,13 |
| 66.631,59 CZK | 2.623,32 EUR | 19/10/2021 | 2.623,32 | 3,68 |
| 41.444,64 THB | 1.056,76 EUR | 19/10/2021 | 1.056,76 | (0,29) |
| 9.154,31 GBP | 49.089,19 PLN | 19/10/2021 | 10.614,09 | (15,03) |
| 7.889,46 PLN | 16.119,22 HKD | 19/10/2021 | 1.745,57 | (72,58) |
| 34.603,84 EUR | 880.145,33 CZK | 19/10/2021 | 34.603,84 | (96,60) |
| 11.599,73 EUR | 56.090,81 PEN | 20/10/2021 | 11.599,73 | (98,03) |
| 4.939,61 EUR | 45.503,70 HKD | 19/10/2021 | 4.939,61 | (102,77) |
| 1.890.000,00 CZK | 74.399,90 EUR | 17/12/2021 | 74.399,90 | (121,86) |
| 31.331,27 PLN | 34.391,68 RON | 19/10/2021 | 6.932,15 | (135,43) |
| 22.904,14 PLN | 24.563,45 PEN | 20/10/2021 | 5.067,62 | (147,93) |
| 135.584,40 EUR | 146.876,55 CHF | 19/10/2021 | 135.584,40 | (283,08) |
| 55.667,28 PLN | 314.063,64 CZK | 19/10/2021 | 12.316,57 | (290,99) |
| 40.505,37 PLN | 40.292.710,58 COP | 21/10/2021 | 8.961,95 | (308,98) |
| 81.570,75 PLN | 30.340,11 NZD | 19/10/2021 | 18.038,70 | (335,23) |
| 25.959,69 EUR | 116.432.072,17 COP | 21/10/2021 | 25.959,69 | (355,23) |
| 46.330,32 PLN | 105.556,26 NOK | 19/10/2021 | 10.250,73 | (366,34) |
| 27.647,80 EUR | 284.003,18 NOK | 19/10/2021 | 27.647,80 | (413,22) |
| 106.339,76 PLN | 561.941,99 MXN | 19/10/2021 | 23.528,02 | (436,69) |
| 107.647,86 PLN | 177.445,59 DKK | 19/10/2021 | 23.821,89 | (481,08) |
| 68.811,58 PLN | 57.885,47 ILS | 19/10/2021 | 15.224,79 | (532,36) |
| 40.216,88 EUR | 152.538,61 ILS | 19/10/2021 | 40.216,88 | (572,00) |
| 88.654,14 PLN | 31.335,31 SGD | 19/10/2021 | 19.615,02 | (653,16) |
| 52.727,12 EUR | 84.026,18 SGD | 19/10/2021 | 52.727,12 | (659,99) |
| 109.634,64 EUR | 1.118.541,84 SEK | 19/10/2021 | 109.634,64 | (664,39) |
| 74.974,22 PLN | 1.451.231,48 RUB | 20/10/2021 | 16.588,29 | (862,73) |
| 135.978,46 PLN | 148.789,82 MYR | 21/10/2021 | 30.088,15 | (1.093,32) |
| 188.607,84 PLN | 426.786,05 SEK | 19/10/2021 | 41.734,62 | (1.118,63) |
| 229.063,25 PLN | 55.038,87 CHF | 19/10/2021 | 50.680,99 | (1.159,74) |
| 77.402,51 EUR | 381.846,57 MYR | 21/10/2021 | 77.402,51 | (1.197,85) |
| 45.070,81 EUR | 3.933.420,55 RUB | 20/10/2021 | 45.070,81 | (1.404,94) |
| 18.270.000,00 HUF | 52.058,03 EUR | 17/12/2021 | 52.058,03 | (1.411,73) |
| 386.632,39 EUR | 623.041,00 AUD | 19/10/2021 | 386.632,39 | (1.606,43) |
| 183.081,28 PLN | 688.946.980,00 IDR | 22/10/2021 | 40.511,59 | (1.679,12) |
| 104.879,60 EUR | 1.779.580.085,00 IDR | 22/10/2021 | 104.879,60 | (2.169,03) |
| 523.933,12 PLN | 159.339.636,00 KRW | 20/10/2021 | 115.926,92 | (2.301,09) |
| 665.161,55 PLN | 237.708,92 AUD | 19/10/2021 | 147.183,92 | (3.648,31) |
| 6.930.000,00 THB | 210.487,63 USD | 17/12/2021 | 177.927,99 | (4.958,61) |
| 876.621,28 EUR | 1.026.000,00 USD | 17/12/2021 | 876.621,28 | (7.229,07) |
| 909.400.000,00 KRW | 776.302,87 USD | 17/12/2021 | 657.709,23 | (7.544,01) |
| 1.450.000,00 NZD | 869.388,47 EUR | 17/12/2021 | 869.388,47 | (8.214,47) |
| 2.303.598,49 PLN | 438.917,44 GBP | 19/10/2021 | 509.678,70 | (10.152,26) |
| 1.309.702,07 PLN | 433.038,61 CAD | 19/10/2021 | 289.796,75 | (10.373,65) |
| 2.000.000,00 GBP | 2.334.506,81 EUR | 17/12/2021 | 2.334.506,81 | (11.097,53) |
| 749.623,73 EUR | 1.117.374,22 CAD | 19/10/2021 | 749.623,73 | (11.174,86) |
| 56.144.380.000,00 IDR | 3.907.898,02 USD | 17/12/2021 | 3.327.687,65 | (15.795,71) |
| 3.106.452,48 EUR | 31.680.000,00 NOK | 17/12/2021 | 3.106.452,48 | (17.879,67) |
| 3.109.139,37 EUR | 4.603.000,00 CAD | 17/12/2021 | 3.109.139,37 | (20.847,92) |
| 7.500.641,43 EUR | 8.130.000,00 CHF | 17/12/2021 | 7.500.641,43 | (22.065,49) |
| 4.554.276,56 EUR | 46.471.000,00 SEK | 17/12/2021 | 4.554.276,56 | (25.171,71) |
| 3.505.877,52 EUR | 457.136.277,00 JPY | 19/10/2021 | 3.505.877,52 | (28.652,17) |
| 4.147.875,82 EUR | 6.710.000,00 AUD | 17/12/2021 | 4.147.875,82 | (29.147,80) |
| 3.302.551,10 PLN | 5.627.481,75 CNY | 20/10/2021 | 730.681,98 | (33.727,93) |
| 76.530.000,00 MXN | 3.211.736,17 EUR | 17/12/2021 | 3.211.736,17 | (38.441,83) |
| 2.980.463,20 EUR | 11.300.000,00 ILS | 17/12/2021 | 2.980.463,20 | (39.115,43) |
| 6.163.333,28 PLN | 178.249.967,00 JPY | 19/10/2021 | 1.363.770,25 | (39.502,47) |
| 1.882.718,31 EUR | 14.466.799,26 CNY | 20/10/2021 | 1.882.718,31 | (48.021,43) |
| 11.541.772,42 PLN | 2.559.867,71 EUR | 19/10/2021 | 2.559.867,71 | (52.935,63) |
| 19.759.286,03 PLN | 5.191.966,95 USD | 19/10/2021 | 4.372.208,59 | (186.748,92) |
| 11.336.472,38 EUR | 13.429.581,95 USD | 19/10/2021 | 11.336.472,38 | (247.823,85) |
| | | | **128.076.158,06** | **(467.741,53)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Bond Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| 93 | AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/12/2021 | AUD | 8.200.458,74 | (149.002,97) |
| 32 | AUSTRALIA 3YR BOND FUTURE 15/12/2021 | AUD | 2.322.351,70 | (3.190,28) |
| (16) | CANADA 10YR BOND FUTURE 20/12/2021 | CAD | 1.559.988,63 | 1.974,74 |
| 91 | EURO-BTP FUTURE 08/12/2021 | EUR | 13.827.450,00 | (210.031,45) |
| 100 | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 16.982.000,00 | 16.105,65 |
| (14) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 2.846.760,00 | 94.919,49 |
| (50) | EURO-OAT FUTURE 08/12/2021 | EUR | 8.297.500,00 | 55.341,05 |
| (37) | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 4.151.585,00 | 3.145,00 |
| 1 | JAPAN 10Y BOND (OSE) 13/12/2021 | JPY | 1.170.599,16 | (3.170,68) |
| 30 | KOREA 3YR BOND FUTURE 21/12/2021 | KRW | 2.391.784,94 | (7.427,03) |
| (7) | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 1.019.217,35 | 3.341,76 |
| (2) | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 274.763,79 | 929,74 |
| 57 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 9.396.921,78 | (293.992,35) |
| (2) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 227.118,30 | (272,96) |
| (272) | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 34.089.477,54 | 639.915,73 |
| | | | **106.757.976,93** | **148.585,44** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **1.511.418,57** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **53.416.132,32** | **88,37** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **1.511.418,57** | **2,50** |
| **Bankguthaben** | **5.290.768,56** | **8,75** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **226.625,90** | **0,38** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **60.444.945,35** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Convertible Bond

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 84.468.070,37 |
| | 30.09.2020 | USD | 101.891.790,82 |
| | 30.09.2019 | USD | 168.369.173,82 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.202,84 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.635,32 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.132,20 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.755,44 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.283,10 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.913,02 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 118,46 |
| | 30.09.2020 | GBP | 107,98 |
| | 30.09.2019 | GBP | 99,96 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 304,07 |
| | 30.09.2020 | USD | 277,44 |
| | 30.09.2019 | USD | 254,32 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 282,08 |
| | 30.09.2020 | EUR | 260,08 |
| | 30.09.2019 | EUR | 243,47 |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 118,20 |
| | 30.09.2020 | GBP | 107,94 |
| | 30.09.2019 | GBP | 99,95 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.348,95 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.734,96 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.185,65 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 0,53 |
| | 30.09.2020 | | 814 |
| | 30.09.2019 | | 15.531 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 739 |
| | 30.09.2020 | | 7 |
| | 30.09.2019 | | 7 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | | 19 |
| | 30.09.2020 | | 365 |
| | 30.09.2019 | | 365 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 9 |
| | 30.09.2020 | | 32 |
| | 30.09.2019 | | 32 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 7 |
| | 30.09.2020 | | 29 |
| | 30.09.2019 | | 29 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 22 |
| | 30.09.2020 | 73 |
| | 30.09.2019 | 73 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | 12.525 |
| | 30.09.2020 | 16.945 |
| | 30.09.2019 | 17.076 |
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,64% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,68% |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,68% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,08% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,10% |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,82% |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | 0,16% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 132,46% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Convertible Bond

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **80.186.770,82** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 80.186.770,82 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **63.274,48** |
| Devisentermingeschäfte | | 63.274,48 |
| **Bankguthaben** | | **10.557.073,79** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **66.755,32** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **874.238,32** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***91.748.112,73*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(7.265.193,04)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(14.849,32)** |
| Futures | | (14.849,32) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(7.280.042,36)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***84.468.070,37*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **3.429,02** |
| Dividenden | | 3.429,02 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.550.809,11)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (28.671,65) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (141.071,85) |
| Abonnementsteuer | 9 | (9.024,47) |
| Bankzinsen | | (3.451,69) |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | (1.367.318,91) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (1.270,54) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(1.547.380,09)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 15.848.187,34 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (952.253,88) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 3.361.225,93 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (2.661.930,74) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 282.268,06 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (260.721,60) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (4.032.578,88) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 163.906,45 |
| **Ergebnis** | | **10.200.722,59** |
| Zeichnungen | | 4.610.754,23 |
| Rücknahmen | | (32.235.197,27) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 101.891.790,82 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***84.468.070,37*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Convertible Bond

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

**Anleihen und andere Schuldtitel**

**Vereinigte Staaten**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1.000.000 | AIRBNB INC ZCP 15/03/2026 | USD | 985.647,94 | 1,17 |
| 1.597.000 | AKAMAI TECHNOLOGIES INC 0.125% 01/05/2025 | USD | 1.938.713,57 | 2,30 |
| 850.000 | BENTLEY SYSTEMS INC 0.375% 01/07/2027 | USD | 863.211,63 | 1,02 |
| 550.000 | BEYOND MEAT INC ZCP 15/03/2027 | USD | 475.826,75 | 0,56 |
| 485.000 | CABLE ONE INC ZCP 15/03/2026 | USD | 475.977,84 | 0,56 |
| 1.650.000 | CHEGG INC ZCP 01/09/2026 | USD | 1.625.446,27 | 1,92 |
| 945.000 | COUPA SOFTWARE INC 0.375% 15/06/2026 | USD | 1.021.632,37 | 1,21 |
| 1.599.000 | DEXCOM INC 0.250% 15/11/2025 | USD | 1.903.008,42 | 2,25 |
| 1.560.000 | DOCUSIGN INC ZCP 15/01/2024 | USD | 1.629.634,97 | 1,93 |
| 785.000 | DROPBOX INC ZCP 01/03/2026 | USD | 819.268,51 | 0,97 |
| 800.000 | ENPHASE ENERGY INC ZCP 01/03/2028 | USD | 739.431,35 | 0,88 |
| 600.000 | ENVESTNET INC 0.750% 15/08/2025 | USD | 606.391,84 | 0,72 |
| 440.000 | ETSY INC 0.125% 01/09/2027 | USD | 579.225,35 | 0,69 |
| 520.000 | ETSY INC 0.250% 15/06/2028 | USD | 592.834,03 | 0,70 |
| 555.000 | EURONET WORLDWIDE INC 0.750% 15/03/2049 | USD | 609.829,85 | 0,72 |
| 700.000 | EXPEDIA GROUP INC ZCP 15/02/2026 | USD | 755.469,90 | 0,89 |
| 1.300.000 | FORD MOTOR CO ZCP 15/03/2026 | USD | 1.402.669,52 | 1,66 |
| 500.000 | FORTIVE CORP 0.875% 15/02/2022 | USD | 501.114,32 | 0,59 |
| 926.000 | ILLUMINA INC ZCP 15/08/2023 | USD | 1.082.870,18 | 1,28 |
| 300.000 | JPMORGAN CHASE BANK NA ZCP 10/06/2024 | EUR | 378.613,44 | 0,45 |
| 700.000 | JPMORGAN CHASE BANK NA ZCP 18/02/2024 | EUR | 907.188,11 | 1,07 |
| 604.000 | JPMORGAN CHASE FINANCIAL CO LLC 0.250% 01/05/2023 | USD | 650.648,45 | 0,77 |
| 550.000 | LIBERTY MEDIA CORP 2.750% 01/12/2049 | USD | 570.900,89 | 0,68 |
| 1.334.000 | LUMENTUM HOLDINGS INC 0.500% 15/12/2026 | USD | 1.466.958,97 | 1,74 |
| 1.200.000 | NEXTERA ENERGY PARTNERS LP ZCP 15/11/2025 | USD | 1.273.516,44 | 1,51 |
| 400.000 | NORTONLIFELOCK INC 2.000% 15/08/2022 | USD | 511.061,54 | 0,61 |
| 1.453.000 | NRG ENERGY INC 2.750% 01/06/2048 | USD | 1.697.997,89 | 2,01 |
| 820.000 | OKTA INC 0.375% 15/06/2026 | USD | 1.004.804,16 | 1,19 |
| 1.350.000 | ON SEMICONDUCTOR CORP ZCP 01/05/2027 | USD | 1.606.956,88 | 1,90 |
| 350.000 | PEBBLEBROOK HOTEL TRUST 1.750% 15/12/2026 | USD | 391.324,21 | 0,46 |
| 297.000 | PURE STORAGE INC 0.125% 15/04/2023 | USD | 343.763,76 | 0,41 |
| 1.957.000 | RINGCENTRAL INC ZCP 01/03/2025 | USD | 1.930.456,86 | 2,30 |
| 500.000 | SNAP INC ZCP 01/05/2027 | USD | 576.667,22 | 0,68 |
| 650.000 | SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC ZCP 15/09/2025 | USD | 806.290,67 | 0,95 |
| 1.250.000 | SPLUNK INC 0.500% 15/09/2023 | USD | 1.460.235,13 | 1,73 |
| 500.000 | SPLUNK INC 1.125% 15/09/2025 | USD | 610.087,26 | 0,72 |
| 510.000 | SQUARE INC ZCP 01/05/2026 | USD | 584.438,65 | 0,69 |
| 300.000 | SQUARE INC 0.250% 01/11/2027 | USD | 355.373,14 | 0,42 |
| 250.000 | TYLER TECHNOLOGIES INC 0.250% 15/03/2026 | USD | 274.243,30 | 0,32 |
| 450.000 | VAIL RESORTS INC ZCP 01/01/2026 | USD | 481.602,26 | 0,57 |
| 583.000 | VIAVI SOLUTIONS INC 1.000% 01/03/2024 | USD | 760.309,74 | 0,90 |
| 577.000 | VISHAY INTERTECHNOLOGY INC 2.250% 15/06/2025 | USD | 594.296,32 | 0,70 |
| 780.000 | ZYNGA INC ZCP 15/12/2026 | USD | 756.748,40 | 0,90 |
| | | | **38.602.688,30** | **45,70** |

**Frankreich**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 792.296 | ACCOR SA 0.700% 07/12/2027 | EUR | 1.003.745,18 | 1,18 |
| 600.000 | ATOS SE ZCP 06/11/2024 | EUR | 792.722,44 | 0,94 |
| 600.000 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA ZCP 10/01/2022 | USD | 621.803,41 | 0,74 |
| 375.033 | EDENRED ZCP 06/09/2024 | EUR | 444.148,99 | 0,53 |
| 1.071.818 | ELECTRICITE ZCP 14/09/2024 | EUR | 1.606.850,04 | 1,89 |
| 400.000 | KERING SA ZCP 30/09/2022 | EUR | 521.289,33 | 0,62 |
| 300.472 | ORPEA SA 0.375% 17/05/2027 | EUR | 349.424,14 | 0,41 |
| 405.812 | SCHNEIDER ELECTRIC SE ZCP 15/06/2026 | EUR | 557.742,93 | 0,66 |
| 353.213 | SOITEC ZCP 01/10/2025 | EUR | 528.428,70 | 0,63 |
| 600.000 | TOTALENERGIES SE 0.500% 02/12/2022 | USD | 608.119,69 | 0,72 |
| 600.000 | VINCI SA 0.375% 16/02/2022 | USD | 666.140,85 | 0,79 |
| 774.000 | WORLDLINE SA ZCP 30/07/2026 | EUR | 975.877,43 | 1,16 |
| | | | **8.676.293,13** | **10,27** |

**Niederlande**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 400.000 | AMERICA MOVIL BV ZCP 02/03/2024 | EUR | 480.106,96 | 0,57 |
| 500.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 11/11/2022 | EUR | 640.013,38 | 0,76 |
| 1.600.000 | JUST EAT TAKEAWAY.COM NV ZCP 09/08/2025 | EUR | 1.690.294,93 | 2,00 |
| 400.000 | QIAGEN NV 0.500% 13/09/2023 | USD | 520.132,04 | 0,62 |
| 600.000 | QIAGEN NV 1.000% 13/11/2024 | USD | 743.413,18 | 0,88 |
| 1.800.000 | STMICROELECTRONICS NV ZCP 04/08/2025 | USD | 2.264.772,73 | 2,67 |
| | | | **6.338.733,22** | **7,50** |

**Deutschland**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 400.000 | ADIDAS AG 0.050% 12/09/2023 | EUR | 553.862,80 | 0,66 |
| 800.000 | LEG IMMOBILIEN SE 0.875% 01/09/2025 | EUR | 1.121.966,57 | 1,32 |
| 600.000 | RAG-STIFTUNG ZCP 16/03/2023 | EUR | 707.734,00 | 0,84 |
| 300.000 | RAG-STIFTUNG ZCP 17/06/2026 | EUR | 386.633,00 | 0,46 |
| 400.000 | TAG IMMOBILIEN AG 0.625% 27/08/2026 | EUR | 478.151,25 | 0,57 |
| 300.000 | ZALANDO SE 0.050% 06/08/2025 | EUR | 401.047,61 | 0,47 |
| 300.000 | ZALANDO SE 0.625% 06/08/2027 | EUR | 403.370,37 | 0,48 |
| | | | **4.052.765,60** | **4,80** |

**Japan**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 20.000.000 | CHUGOKU ELECTRIC POWER CO INC/THE ZCP 25/01/2022 | JPY | 178.970,70 | 0,21 |
| 20.000.000 | DMG MORI CO LTD ZCP 16/07/2024 | JPY | 194.140,17 | 0,23 |
| 30.000.000 | KANSAI PAINT CO LTD ZCP 17/06/2022 | JPY | 275.296,11 | 0,33 |
| 30.000.000 | MERCARI INC ZCP 14/07/2026 | JPY | 284.903,59 | 0,34 |
| 30.000.000 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS CORP ZCP 29/03/2024 | JPY | 293.379,98 | 0,35 |
| 50.000.000 | NAGOYA RAILROAD CO LTD ZCP 11/12/2024 | JPY | 454.693,28 | 0,54 |
| 50.000.000 | NIPPON STEEL CORP ZCP 04/10/2024 | JPY | 466.321,08 | 0,55 |
| 50.000.000 | NIPPON STEEL CORP ZCP 05/10/2026 | JPY | 467.599,91 | 0,55 |
| 30.000.000 | ROHM CO LTD ZCP 05/12/2024 | JPY | 295.509,16 | 0,35 |
| | | | **2.910.813,98** | **3,45** |

**Spanien**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 400.000 | AMADEUS IT GROUP SA 1.500% 09/04/2025 | EUR | 613.785,92 | 0,73 |
| 900.000 | CELLNEX TELECOM SA 0.500% 05/07/2028 | EUR | 1.414.514,10 | 1,67 |
| 400.000 | CELLNEX TELECOM SA 0.750% 20/11/2031 | EUR | 458.314,63 | 0,54 |
| | | | **2.486.614,65** | **2,94** |

**Kaimaninseln**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 3.000.000 | KINGSOFT CORP LTD 0.625% 29/04/2025 | HKD | 443.569,82 | 0,53 |
| 700.000 | MEITUAN ZCP 27/04/2027 | USD | 674.854,31 | 0,80 |
| 700.000 | MEITUAN ZCP 27/04/2028 | USD | 669.457,64 | 0,79 |
| 500.000 | ZHEN DING TECHNOLOGY HOLDING LTD ZCP 30/06/2025 | USD | 500.333,28 | 0,59 |
| | | | **2.288.215,05** | **2,71** |

**Taiwan**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1.600.000 | GLOBALWAFERS CO LTD ZCP 01/06/2026 | USD | 1.671.244,98 | 1,98 |
| 400.000 | UNITED MICROELECTRONICS CORPORATION ZCP 07/07/2026 | USD | 399.571,82 | 0,47 |
| 200.000 | WIN SEMICONDUCTORS CORP ZCP 14/01/2026 | USD | 198.617,78 | 0,24 |
| | | | **2.269.434,58** | **2,69** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Convertible Bond

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Israel** | | | |
| 758.000 | CYBERARK SOFTWARE LTD ZCP 15/11/2024 | USD | 898.284,30 | 1,07 |
| 500.000 | NICE LTD ZCP 15/09/2025 | USD | 584.238,08 | 0,69 |
| 520.000 | WIX.COM LTD ZCP 15/08/2025 | USD | 500.630,80 | 0,59 |
| | | | **1.983.153,18** | **2,35** |
| | **Italien** | | | |
| 300.000 | DIASORIN SPA ZCP 05/05/2028 | EUR | 384.323,15 | 0,45 |
| 400.000 | NEXI SPA ZCP 24/02/2028 | EUR | 448.369,42 | 0,53 |
| 200.000 | NEXI SPA 1.750% 24/04/2027 | EUR | 268.394,50 | 0,32 |
| 500.000 | PIRELLI & C SPA ZCP 22/12/2025 | EUR | 608.781,01 | 0,72 |
| 200.000 | SNAM SPA ZCP 20/03/2022 | EUR | 243.578,24 | 0,29 |
| | | | **1.953.446,32** | **2,31** |
| | **Singapur** | | | |
| 300.000 | SGX TREASURY I PTE LTD ZCP 01/03/2024 | EUR | 355.002,15 | 0,42 |
| 1.500.000 | SINGAPORE AIRLINES LTD 1.625% 03/12/2025 | SGD | 1.235.346,92 | 1,46 |
| | | | **1.590.349,07** | **1,88** |
| | **Hongkong** | | | |
| 700.000 | XIAOMI BEST TIME INTERNATIONAL ZCP 17/12/2027 | USD | 712.075,05 | 0,84 |
| | | | **712.075,05** | **0,84** |
| | **Kanada** | | | |
| 500.000 | SHOPIFY INC 0.125% 01/11/2025 | USD | 610.470,48 | 0,72 |
| | | | **610.470,48** | **0,72** |
| | **Vereinigte Arabische Emirate** | | | |
| 600.000 | ABU DHABI NATIONAL OIL CO 0.700% 04/06/2024 | USD | 597.568,41 | 0,71 |
| | | | **597.568,41** | **0,71** |
| | **Malaysia** | | | |
| 600.000 | CERAH CAPITAL LTD ZCP 08/08/2024 | USD | 597.192,92 | 0,71 |
| | | | **597.192,92** | **0,71** |
| | **Dänemark** | | | |
| 400.000 | GN STORE NORD AS ZCP 21/05/2024 | EUR | 526.329,35 | 0,62 |
| | | | **526.329,35** | **0,62** |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 4.000.000 | LINK CB LTD 1.600% 03/04/2024 | HKD | 515.341,97 | 0,61 |
| | | | **515.341,97** | **0,61** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 400.000 | GRAND CITY PROPERTIES SA 0.250% 02/03/2022 | EUR | 470.511,05 | 0,57 |
| | | | **470.511,05** | **0,57** |
| | **Südkorea** | | | |
| 400.000 | LG DISPLAY CO LTD 1.500% 22/08/2024 | USD | 431.363,50 | 0,51 |
| | | | **431.363,50** | **0,51** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 400.000 | XERO INVESTMENTS LTD ZCP 02/12/2025 | USD | 394.788,56 | 0,47 |
| | | | **394.788,56** | **0,47** |
| | **Australien** | | | |
| 300.000 | SEVEN GROUP HOLDINGS LTD 2.200% 05/03/2025 | AUD | 230.716,91 | 0,27 |
| | | | **230.716,91** | **0,27** |
| | | | **78.238.865,28** | **92,63** |

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Anleihen und andere Schuldtitel

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Japan** | | | |
| 20.000.000 | DIGITAL GARAGE INC ZCP 14/09/2023 | JPY | 199.076,93 | 0,24 |
| 50.000.000 | MEDIPAL HOLDINGS CORP ZCP 07/10/2022 | JPY | 466.611,19 | 0,55 |
| 60.000.000 | MENICON CO LTD ZCP 29/01/2025 | JPY | 673.844,37 | 0,79 |
| 20.000.000 | SENKO GROUP HOLDINGS CO LTD ZCP 18/03/2025 | JPY | 188.573,52 | 0,22 |
| 40.000.000 | SHIP HEALTHCARE HOLDINGS INC ZCP 13/12/2023 | JPY | 419.799,53 | 0,50 |
| | | | **1.947.905,54** | **2,30** |
| | | | **1.947.905,54** | **2,30** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **80.186.770,82** | **94,93** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 21.133.714,92 | USD | 18.048.969,10 | EUR | 31/12/2021 | 21.133.714,92 | 172.815,79 |
| 4.191.879,37 | USD | 466.645.000,00 | JPY | 30/12/2021 | 4.191.879,37 | 5.475,51 |
| 137.451,06 | USD | 101.000,00 | GBP | 31/12/2021 | 137.451,06 | 1.232,59 |
| 251.257,66 | USD | 346.000,00 | AUD | 31/12/2021 | 251.257,66 | 1.197,67 |
| 1.017.923,03 | USD | 7.920.000,00 | HKD | 31/12/2021 | 1.017.923,03 | 309,97 |
| 11.893,39 | USD | 11.000,00 | CHF | 31/12/2021 | 11.893,39 | 72,60 |
| 115,71 | USD | 85,15 | GBP | 19/10/2021 | 115,71 | 0,89 |
| 50,18 | USD | 43,29 | EUR | 19/10/2021 | 50,18 | (0,01) |
| 2.000,00 | SGD | 1.473,47 | USD | 31/12/2021 | 1.473,47 | (0,57) |
| 4.976,42 | GBP | 6.861,26 | USD | 19/10/2021 | 6.861,26 | (151,17) |
| 4.321.929,82 | EUR | 5.128.060,05 | USD | 19/10/2021 | 5.128.060,05 | (117.678,79) |
| | | | | | **31.880.680,10** | **63.274,48** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Convertible Bond

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Futures auf Aktienindizes** | | | | |
| 1 | HANG SENG INDEX FUTURE 28/10/2021 | HKD | 157.515,11 | 1.303,85 |
| 2 | S&P500 EMINI FUTURE 17/12/2021 | USD | 429.775,00 | (16.153,17) |
| | | | **587.290,11** | **(14.849,32)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **48.425,16** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **80.186.770,82** | **94,93** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **48.425,16** | **0,06** |
| **Bankguthaben** | **10.557.073,79** | **12,50** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(6.324.199,40)** | **(7,49)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **84.468.070,37** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Convertible Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 1.015.834.241,01 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.205.349.629,65 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.462.083.660,26 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 187,71 |
| | 30.09.2020 | USD | 170,72 |
| | 30.09.2019 | USD | 161,22 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 5.529,98 |
| | 30.09.2020 | CHF | 5.091,29 |
| | 30.09.2019 | CHF | 4.922,64 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 154,85 |
| | 30.09.2020 | EUR | 142,31 |
| | 30.09.2019 | EUR | 137,16 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 173,76 |
| | 30.09.2020 | GBP | 158,70 |
| | 30.09.2019 | GBP | 152,30 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 314,62 |
| | 30.09.2020 | USD | 287,90 |
| | 30.09.2019 | USD | 273,43 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 145,74 |
| | 30.09.2020 | EUR | 134,79 |
| | 30.09.2019 | EUR | 130,79 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 290,73 |
| | 30.09.2020 | USD | 264,47 |
| | 30.09.2019 | USD | 249,67 |
| Capitalisation R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 278,35 |
| | 30.09.2020 | EUR | 255,81 |
| | 30.09.2019 | EUR | 246,64 |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 124,69 |
| | 30.09.2020 | GBP | 113,94 |
| | 30.09.2019 | GBP | 109,32 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 340,22 |
| | 30.09.2020 | USD | 312,27 |
| | 30.09.2019 | USD | 297,48 |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.362,01 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.802,70 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.554,45 |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.229,84 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.673,24 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.419,58 |
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.004,88 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.857,56 |
| Distribution I (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.866,44 |
| | 30.09.2020 | USD | 6.277,20 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.971,02 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 120,24 |
| | 30.09.2020 | GBP | 110,43 |
| | 30.09.2019 | GBP | 106,72 |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 29,30 |
| | 30.09.2020 | EUR | 27,04 |
| | 30.09.2019 | EUR | 26,24 |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 283,11 |
| | 30.09.2020 | EUR | 263,37 |
| | 30.09.2019 | EUR | 257,17 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 240.166 |
| | 30.09.2020 | 615.572 |
| | 30.09.2019 | 2.256.917 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 235 |
| | 30.09.2020 | 369 |
| | 30.09.2019 | 572 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 3.351.716 |
| | 30.09.2020 | 3.765.292 |
| | 30.09.2019 | 4.312.528 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 467.207 |
| | 30.09.2020 | 469.044 |
| | 30.09.2019 | 461.783 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 9.596 |
| | 30.09.2020 | 24.014 |
| | 30.09.2019 | 23.670 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 15.799 |
| | 30.09.2020 | 51.950 |
| | 30.09.2019 | 60.361 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1.357 |
| | 30.09.2020 | 645 |
| | 30.09.2019 | 649 |
| Capitalisation R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 115.420 |
| | 30.09.2020 | 112.991 |
| | 30.09.2019 | 83.222 |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 259 |
| | 30.09.2020 | 1.021 |
| | 30.09.2019 | 10.828 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2.047 |
| | 30.09.2020 | 1.931 |
| | 30.09.2019 | 1.358 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Convertible Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 5.539 |
| | 30.09.2020 | 8.581 |
| | 30.09.2019 | 11.691 |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 4.442 |
| | 30.09.2020 | 5.645 |
| | 30.09.2019 | 5.645 |
| Distribution I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 10.000 |
| | 30.09.2019 | 10.000 |
| Distribution I (Q) (USD) | 30.09.2021 | 14.865 |
| | 30.09.2020 | 20.158 |
| | 30.09.2019 | 21.926 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 218.191 |
| | 30.09.2020 | 257.045 |
| | 30.09.2019 | 231.570 |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 85.164 |
| | 30.09.2020 | 132.382 |
| | 30.09.2019 | 155.162 |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 3.288 |
| | 30.09.2020 | 5.224 |
| | 30.09.2019 | 5.244 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 8,70 |
| Distribution I (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 8,45 |
| Distribution I (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 8,55 |
| Distribution I (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 9,40 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 11.08.2021 | GBP | 0,15 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 12.05.2021 | GBP | 0,15 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 11.02.2021 | GBP | 0,15 |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 11.11.2020 | GBP | 0,15 |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,15 |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 1,60 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,90% |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,50% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,52% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Capitalisation R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,92% |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,92% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,18% |
| Capitalisation Zz Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,01% |
| Distribution I (Q) (USD) | 30.09.2021 | 0,88% |
| Distribution I (Q) Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Distribution N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,82% |
| Distribution P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,52% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 74,42% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Convertible Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **963.596.657,20** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 27.300.485,00 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 936.296.172,20 |
| **Bankguthaben** | | **82.614.391,81** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **103.786.694,63** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***1.149.997.743,64*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(115.606.028,75)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(18.557.473,88)** |
| Devisentermingeschäfte | | (18.557.473,88) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(134.163.502,63)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.015.834.241,01*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **25.769,52** |
| Bankzinsen | | 25.666,83 |
| Sonstige Erträge | 10 | 102,69 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(22.302.738,93)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (7.538.050,60) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.698.487,06) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (187.240,59) |
| Abonnementsteuer | 9 | (128.386,60) |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | (12.750.574,08) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(22.276.969,41)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 160.875.166,08 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (9.634.081,12) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 32.892.469,89 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (39.994.706,78) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 4.423.167,45 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (3.985.213,74) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (27.270.091,70) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 5.849.233,45 |
| **Ergebnis** | | **100.878.974,12** |
| Zeichnungen | | 254.920.013,56 |
| Rücknahmen | | (544.485.046,35) |
| Ausschüttung | | (829.329,97) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 1.205.349.629,65 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.015.834.241,01*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Convertible Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 25.840.000 | AKAMAI TECHNOLOGIES INC 0.125% 01/05/2025 | USD | 31.369.041,13 | 3,09 |
| 9.350.000 | ARES CAPITAL CORP 4.625% 01/03/2024 | USD | 10.348.717,73 | 1,02 |
| 15.700.000 | BENTLEY SYSTEMS INC 0.375% 01/07/2027 | USD | 15.944.026,51 | 1,57 |
| 31.750.000 | CHEGG INC ZCP 01/09/2026 | USD | 31.277.526,66 | 3,08 |
| 33.220.000 | DEXCOM INC 0.250% 15/11/2025 | USD | 39.535.922,27 | 3,89 |
| 24.400.000 | DOCUSIGN INC ZCP 15/01/2024 | USD | 25.489.162,32 | 2,51 |
| 24.400.000 | HAEMONETICS CORP ZCP 01/03/2026 | USD | 21.230.390,47 | 2,09 |
| 19.090.000 | ILLUMINA INC ZCP 15/08/2023 | USD | 22.323.965,12 | 2,20 |
| 17.100.000 | JPMORGAN CHASE BANK NA ZCP 18/02/2024 | EUR | 22.161.309,66 | 2,18 |
| 27.080.000 | LUMENTUM HOLDINGS INC 0.500% 15/12/2026 | USD | 29.779.047,08 | 2,93 |
| 21.550.000 | NEXTERA ENERGY PARTNERS LP ZCP 15/11/2025 | USD | 22.870.232,74 | 2,25 |
| 31.400.000 | NRG ENERGY INC 2.750% 01/06/2048 | USD | 36.694.517,28 | 3,61 |
| 14.500.000 | OKTA INC 0.375% 15/06/2026 | USD | 17.767.878,49 | 1,75 |
| 25.700.000 | ON SEMICONDUCTOR CORP ZCP 01/05/2027 | USD | 30.591.697,65 | 3,01 |
| 37.205.000 | RINGCENTRAL INC ZCP 01/03/2025 | USD | 36.700.381,89 | 3,62 |
| 5.965.000 | SILICON LABORATORIES INC 0.625% 15/06/2025 | USD | 7.679.750,26 | 0,76 |
| 12.700.000 | SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC ZCP 15/09/2025 | USD | 15.753.679,31 | 1,55 |
| 33.000.000 | SPLUNK INC 1.125% 15/09/2025 | USD | 40.265.759,16 | 3,96 |
| 20.455.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 4.375% 01/04/2023 | USD | 21.558.060,83 | 2,12 |
| 12.100.000 | VIAVI SOLUTIONS INC 1.000% 01/03/2024 | USD | 15.780.013,41 | 1,55 |
| 21.000.000 | ZYNGA INC ZCP 15/12/2026 | USD | 20.373.995,46 | 2,01 |
| | | | **515.495.075,43** | **50,75** |
| **Niederlande** | | | | |
| 11.100.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV ZCP 11/11/2022 | EUR | 14.208.296,91 | 1,40 |
| 24.700.000 | JUST EAT TAKEAWAY.COM NV ZCP 09/08/2025 | EUR | 26.093.927,95 | 2,57 |
| 3.500.000 | JUST EAT TAKEAWAY.COM NV 2.250% 25/01/2024 | EUR | 4.726.226,64 | 0,47 |
| 18.200.000 | QIAGEN NV 0.500% 13/09/2023 | USD | 23.666.007,64 | 2,33 |
| 34.600.000 | STMICROELECTRONICS NV ZCP 04/08/2025 | USD | 43.533.964,62 | 4,28 |
| | | | **112.228.423,76** | **11,05** |
| **Frankreich** | | | | |
| 15.542.760 | ACCOR SA 0.700% 07/12/2027 | EUR | 19.690.840,82 | 1,94 |
| 19.600.000 | ATOS SE ZCP 06/11/2024 | EUR | 25.895.599,49 | 2,54 |
| 13.355.083 | ELECTRICITE ZCP 14/09/2024 | EUR | 20.021.703,47 | 1,97 |
| 16.944.105 | SOITEC ZCP 01/10/2025 | EUR | 25.349.449,69 | 2,50 |
| 11.800.000 | VINCI SA 0.375% 16/02/2022 | USD | 13.100.770,05 | 1,29 |
| | | | **104.058.363,52** | **10,24** |
| **Spanien** | | | | |
| 7.500.000 | AMADEUS IT GROUP SA 1.500% 09/04/2025 | EUR | 11.508.486,05 | 1,13 |
| 19.900.000 | CELLNEX TELECOM SA 0.500% 05/07/2028 | EUR | 31.276.478,35 | 3,08 |
| | | | **42.784.964,40** | **4,21** |
| **Taiwan** | | | | |
| 34.800.000 | GLOBALWAFERS CO LTD ZCP 01/06/2026 | USD | 36.349.578,23 | 3,58 |
| | | | **36.349.578,23** | **3,58** |
| **Deutschland** | | | | |
| 15.800.000 | LEG IMMOBILIEN SE 0.875% 01/09/2025 | EUR | 22.158.839,76 | 2,18 |
| 8.500.000 | ZALANDO SE 0.050% 06/08/2025 | EUR | 11.363.015,63 | 1,12 |
| | | | **33.521.855,39** | **3,30** |
| **Singapur** | | | | |
| 30.250.000 | SINGAPORE AIRLINES LTD 1.625% 03/12/2025 | SGD | 24.912.829,57 | 2,45 |
| | | | **24.912.829,57** | **2,45** |
| **Israel** | | | | |
| 15.750.000 | CYBERARK SOFTWARE LTD ZCP 15/11/2024 | USD | 18.664.878,17 | 1,84 |
| | | | **18.664.878,17** | **1,84** |
| **Österreich** | | | | |
| 13.300.000 | IMMOFINANZ AG 1.500% 24/01/2024 | EUR | 16.807.030,04 | 1,65 |
| | | | **16.807.030,04** | **1,65** |
| **Kanada** | | | | |
| 12.900.000 | SHOPIFY INC 0.125% 01/11/2025 | USD | 15.750.138,26 | 1,55 |
| | | | **15.750.138,26** | **1,55** |
| | | | **920.573.136,77** | **90,62** |
| **Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Japan** | | | | |
| 1.400.000.000 | MENICON CO LTD ZCP 29/01/2025 | JPY | 15.723.035,43 | 1,55 |
| | | | **15.723.035,43** | **1,55** |
| | | | **15.723.035,43** | **1,55** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| **Luxemburg** | | | | |
| 4.300 | NN (L) GLOBAL CONVERTIBLE BOND - Z CAP USD | USD | 27.300.485,00 | 2,69 |
| | | | **27.300.485,00** | **2,69** |
| | | | **27.300.485,00** | **2,69** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **963.596.657,20** | **94,86** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 257.311.113,67 | USD | 219.781.116,28 | EUR | 31/12/2021 | 257.311.113,67 | 2.071.615,90 |
| 24.378.319,90 | USD | 20.847.389,93 | EUR | 19/10/2021 | 24.378.319,90 | 210.095,03 |
| 16.545.580,85 | USD | 1.841.831.000,00 | JPY | 30/12/2021 | 16.545.580,85 | 21.995,66 |
| 4.470.725,82 | USD | 3.303.338,34 | GBP | 19/10/2021 | 4.470.725,82 | 16.584,30 |
| 23.545.316,58 | USD | 31.959.000,00 | SGD | 31/12/2021 | 23.545.316,58 | 9.172,81 |
| 261.293,11 | USD | 192.000,00 | GBP | 31/12/2021 | 261.293,11 | 2.343,15 |
| 37.309,46 | USD | 34.813,83 | CHF | 19/10/2021 | 37.309,46 | (24,81) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Convertible Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 1.336.751,85 | CHF | 1.463.677,58 | USD | 19/10/2021 | 1.463.677,58 | (30.148,16) |
| 110.991.968,07 | GBP | 153.030.329,65 | USD | 19/10/2021 | 153.030.329,65 | (3.371.444,37) |
| 642.653.296,76 | EUR | 762.510.874,46 | USD | 19/10/2021 | 762.510.874,46 | (17.487.663,39) |
| | | | | | **1.243.554.541,08** | **(18.557.473,88)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(18.557.473,88)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **963.596.657,20** | **94,86** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(18.557.473,88)** | **(1,83)** |
| **Bankguthaben** | **82.614.391,81** | **8,13** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(11.819.334,12)** | **(1,16)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **1.015.834.241,01** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 762.250.900,82 |
| | 30.09.2020 | USD | 60.869.513,39 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 7.151,20 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.573,63 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 354,97 |
| | 30.09.2020 | USD | 277,68 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 356,69 |
| | 30.09.2020 | USD | 278,38 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 254,12 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.636,47 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.185,91 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 3.733 |
| | 30.09.2020 | | 7 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 9 |
| | 30.09.2020 | | 29 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | | 9 |
| | 30.09.2020 | | 29 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 8 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | | 95.633 |
| | 30.09.2020 | | 10.000 |
| | 30.09.2019 | | - |
| **Dividende** | | | |
| Distribution Z (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 80,40 |

| **Laufende Kosten in %*** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,19% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 0,53% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 0,28% |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,01% |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,11% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 36,77% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **759.232.844,10** |
| Aktien | | 759.232.844,10 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **35.982,36** |
| Optionsscheine und Bezugsrechte | | 35.982,36 |
| **Bankguthaben** | | **1.567.166,98** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **1.506.252,33** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***762.342.245,77*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(91.287,61)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(57,34)** |
| Devisentermingeschäfte | | (57,34) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(91.344,95)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***762.250.900,82*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **11.391.386,59** |
| Dividenden | | 11.391.386,59 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(758.535,30)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (8.297,98) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (667.818,90) |
| Abonnementsteuer | 9 | (79.058,49) |
| Bankzinsen | | (3.359,93) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **10.632.851,29** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 38.360.548,45 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (5.341.530,75) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 871,80 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (59,05) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 10.238.336,10 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (10.591.143,77) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 85.309.993,25 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 35.925,02 |
| **Ergebnis** | | **128.645.792,34** |
| Zeichnungen | | 771.720.620,04 |
| Rücknahmen | | (187.457.228,81) |
| Ausschüttung | | (11.527.796,14) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 60.869.513,39 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***762.250.900,82*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

#### Vereinigte Staaten

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2.342 | A O SMITH CORP | USD | 143.025,94 | 0,02 |
| 27.454 | ABBOTT LABORATORIES | USD | 3.243.141,02 | 0,43 |
| 27.143 | ABBVIE INC | USD | 2.927.915,41 | 0,38 |
| 238 | ABIOMED INC | USD | 77.473,76 | 0,01 |
| 12.329 | ACTIVISION BLIZZARD INC | USD | 954.141,31 | 0,13 |
| 6.622 | ADOBE INC | USD | 3.812.417,84 | 0,50 |
| 20.714 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | USD | 2.131.470,60 | 0,28 |
| 15.908 | AFLAC INC | USD | 829.284,04 | 0,11 |
| 8.117 | AGILENT TECHNOLOGIES INC | USD | 1.278.671,01 | 0,17 |
| 14.346 | AGNC INVESTMENT CORP | USD | 226.236,42 | 0,03 |
| 4.448 | AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC | USD | 1.139.177,28 | 0,15 |
| 3.311 | AKAMAI TECHNOLOGIES INC | USD | 346.297,49 | 0,05 |
| 3.924 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | USD | 749.758,68 | 0,10 |
| 1.437 | ALIGN TECHNOLOGY INC | USD | 956.222,91 | 0,13 |
| 24 | ALLEGHANY CORP | USD | 14.985,84 | 0,00 |
| 7.144 | ALLSTATE CORP/THE | USD | 909.502,64 | 0,12 |
| 10.891 | ALLY FINANCIAL INC | USD | 555.985,55 | 0,07 |
| 2.747 | ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | USD | 518.661,07 | 0,07 |
| 3.963 | ALPHABET INC - A | USD | 10.595.159,76 | 1,39 |
| 4.044 | ALPHABET INC - C | USD | 10.778.513,64 | 1,41 |
| 5.954 | AMAZON.COM INC | USD | 19.559.128,16 | 2,57 |
| 15.418 | AMERICAN EXPRESS CO | USD | 2.582.977,54 | 0,34 |
| 17.408 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC | USD | 955.525,12 | 0,13 |
| 7.398 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 1.963.503,18 | 0,26 |
| 2.425 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 640.491,00 | 0,08 |
| 1.708 | AMERISOURCEBERGEN CORP - A | USD | 204.020,60 | 0,03 |
| 9.605 | AMGEN INC | USD | 2.042.503,25 | 0,27 |
| 34.863 | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | USD | 293.546,46 | 0,04 |
| 1.425 | ANSYS INC | USD | 485.141,25 | 0,06 |
| 3.853 | ANTHEM INC | USD | 1.436.398,40 | 0,19 |
| 220.765 | APPLE INC | USD | 31.238.247,50 | 4,09 |
| 18.616 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 2.396.437,68 | 0,31 |
| 1.238 | ARISTA NETWORKS INC | USD | 425.426,32 | 0,06 |
| 1.087 | ARROW ELECTRONICS INC | USD | 122.059,23 | 0,02 |
| 2.960 | ARTHUR J GALLAGHER & CO | USD | 440.004,00 | 0,06 |
| 125.544 | AT&T INC | USD | 3.390.943,44 | 0,43 |
| 3.519 | AUTODESK INC | USD | 1.003.513,23 | 0,13 |
| 7.221 | AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | USD | 1.443.622,32 | 0,19 |
| 1.254 | AVALARA INC | USD | 219.161,58 | 0,03 |
| 4.347 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 963.469,08 | 0,13 |
| 35.550 | BAKER HUGHES CO - A | USD | 879.151,50 | 0,12 |
| 122.140 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 5.184.843,00 | 0,67 |
| 19.367 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE | USD | 1.003.985,28 | 0,13 |
| 10.478 | BAXTER INTERNATIONAL INC | USD | 842.745,54 | 0,11 |
| 5.116 | BECTON DICKINSON AND CO | USD | 1.257.615,12 | 0,16 |
| 4.220 | BEST BUY CO INC | USD | 446.096,20 | 0,06 |
| 2.929 | BIOGEN INC | USD | 828.877,71 | 0,11 |
| 2.861 | BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | USD | 221.126,69 | 0,03 |
| 601 | BIO-RAD LABORATORIES INC - A | USD | 448.315,95 | 0,06 |
| 492 | BIO-TECHNE CORP | USD | 238.408,44 | 0,03 |
| 330 | BLACK KNIGHT INC | USD | 23.760,00 | 0,00 |
| 823 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 1.953.695,01 | 0,26 |
| 4.717 | BOSTON PROPERTIES INC | USD | 511.086,95 | 0,07 |
| 18.933 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | USD | 821.502,87 | 0,11 |
| 40.051 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 2.369.817,67 | 0,31 |
| 1.132 | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | USD | 188.636,48 | 0,02 |
| 2.898 | BROWN & BROWN INC | USD | 160.694,10 | 0,02 |
| 9.251 | BROWN-FORMAN CORP - B | USD | 619.909,51 | 0,08 |
| 664 | BURLINGTON STORES INC | USD | 188.290,48 | 0,02 |
| 3.863 | CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | USD | 585.012,72 | 0,08 |
| 5.037 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 210.596,97 | 0,03 |
| 4.437 | CARDINAL HEALTH INC | USD | 219.454,02 | 0,03 |
| 1.628 | CARMAX INC | USD | 208.318,88 | 0,03 |
| 14.004 | CARRIER GLOBAL CORP | USD | 724.847,04 | 0,10 |
| 1.344 | CARVANA CO - A | USD | 405.269,76 | 0,05 |
| 1.889 | CATALENT INC | USD | 251.369,23 | 0,03 |
| 2.086 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 258.371,96 | 0,03 |
| 6.765 | CBRE GROUP INC - A | USD | 658.640,40 | 0,09 |
| 8.773 | CENTENE CORP | USD | 546.645,63 | 0,07 |
| 329 | CERIDIAN HCM HOLDING INC | USD | 37.051,98 | 0,00 |
| 2.872 | CERNER CORP | USD | 202.533,44 | 0,03 |
| 2.298 | CH ROBINSON WORLDWIDE INC | USD | 199.926,00 | 0,03 |
| 381 | CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC | USD | 157.227,27 | 0,02 |
| 22.053 | CHARLES SCHWAB CORP/THE | USD | 1.606.340,52 | 0,21 |
| 1.964 | CHARTER COMMUNICATIONS INC - A | USD | 1.428.927,84 | 0,19 |
| 10.039 | CHENIERE ENERGY INC | USD | 980.509,13 | 0,13 |
| 47.298 | CHEVRON CORP | USD | 4.798.382,10 | 0,63 |
| 3.655 | CHURCH & DWIGHT CO INC | USD | 301.793,35 | 0,04 |
| 6.230 | CIGNA CORP | USD | 1.246.996,80 | 0,16 |
| 2.492 | CINCINNATI FINANCIAL CORP | USD | 284.636,24 | 0,04 |
| 1.789 | CINTAS CORP | USD | 681.000,74 | 0,09 |
| 65.982 | CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE | USD | 3.591.400,26 | 0,46 |
| 9.038 | CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | USD | 424.605,24 | 0,06 |
| 1.143 | CITRIX SYSTEMS INC | USD | 122.723,91 | 0,02 |
| 980 | CLOROX CO/THE | USD | 162.297,80 | 0,02 |
| 3.593 | CLOUDFLARE INC - A | USD | 404.751,45 | 0,05 |
| 6.310 | CME GROUP INC - A | USD | 1.220.227,80 | 0,16 |
| 3.581 | COGNEX CORP | USD | 287.267,82 | 0,04 |
| 8.571 | COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP - A | USD | 636.053,91 | 0,08 |
| 14.680 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 1.109.514,40 | 0,15 |
| 67.113 | COMCAST CORP - A | USD | 3.753.630,09 | 0,48 |
| 11.385 | CONAGRA BRANDS INC | USD | 385.609,95 | 0,05 |
| 4.214 | CONSTELLATION BRANDS INC - A | USD | 887.847,66 | 0,12 |
| 898 | COOPER COS INC/THE | USD | 371.152,38 | 0,05 |
| 4.661 | COPART INC | USD | 646.573,92 | 0,08 |
| 18.331 | CORTEVA INC | USD | 771.368,48 | 0,10 |
| 7.690 | COSTAR GROUP INC | USD | 661.801,40 | 0,09 |
| 7.794 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 3.502.233,90 | 0,46 |
| 996 | COUPA SOFTWARE INC | USD | 218.303,28 | 0,03 |
| 2.713 | CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A | USD | 666.801,14 | 0,09 |
| 7.447 | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | USD | 1.290.714,04 | 0,17 |
| 45.541 | CSX CORP | USD | 1.354.389,34 | 0,18 |
| 3.481 | CUMMINS INC | USD | 781.693,36 | 0,10 |
| 21.139 | CVS HEALTH CORP | USD | 1.793.855,54 | 0,24 |
| 10.624 | DANAHER CORP | USD | 3.234.370,56 | 0,42 |
| 546 | DAVITA INC | USD | 63.477,96 | 0,01 |
| 5.323 | DEERE & CO | USD | 1.783.577,61 | 0,23 |
| 3.408 | DELL TECHNOLOGIES INC - C | USD | 354.568,32 | 0,05 |
| 13.505 | DELTA AIR LINES INC | USD | 575.448,05 | 0,08 |
| 6.816 | DENTSPLY SIRONA INC | USD | 395.668,80 | 0,05 |
| 1.475 | DEXCOM INC | USD | 806.618,50 | 0,11 |
| 7.483 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES | USD | 919.286,55 | 0,12 |
| 6.350 | DISH NETWORK CORP - A | USD | 275.971,00 | 0,04 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.778 | DOCUSIGN INC - A | USD | 715.140,54 | 0,09 |
| 601 | DOMINO'S PIZZA INC | USD | 286.652,96 | 0,04 |
| 4.316 | DOVER CORP | USD | 671.138,00 | 0,09 |
| 5.498 | DR HORTON INC | USD | 461.667,06 | 0,06 |
| 3.680 | DROPBOX INC - A | USD | 107.529,60 | 0,01 |
| 11.686 | EBAY INC | USD | 814.163,62 | 0,11 |
| 6.450 | ECOLAB INC | USD | 1.345.599,00 | 0,18 |
| 11.830 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 1.339.274,30 | 0,18 |
| 9.133 | ELANCO ANIMAL HEALTH INC | USD | 291.251,37 | 0,04 |
| 3.827 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 544.390,75 | 0,07 |
| 12.409 | ELI LILLY & CO | USD | 2.867.099,45 | 0,38 |
| 15.347 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 1.445.687,40 | 0,19 |
| 2.321 | ENPHASE ENERGY INC | USD | 348.080,37 | 0,05 |
| 872 | EPAM SYSTEMS INC | USD | 497.458,56 | 0,07 |
| 17.421 | EQUITABLE HOLDINGS INC | USD | 516.358,44 | 0,07 |
| 385 | ERIE INDEMNITY CO - A | USD | 68.691,70 | 0,01 |
| 583 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | USD | 186.408,42 | 0,02 |
| 4.243 | ESTEE LAUDER COS INC/THE - A | USD | 1.272.602,99 | 0,17 |
| 2.072 | ETSY INC | USD | 430.893,12 | 0,06 |
| 38.102 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 3.115.219,52 | 0,41 |
| 3.887 | EXACT SCIENCES CORP | USD | 371.014,15 | 0,05 |
| 2.925 | EXPEDIA GROUP INC | USD | 479.407,50 | 0,06 |
| 3.436 | EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC | USD | 409.330,68 | 0,05 |
| 491 | FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | USD | 193.836,98 | 0,03 |
| 181 | FAIR ISAAC CORP | USD | 72.025,33 | 0,01 |
| 13.041 | FASTENAL CO | USD | 673.046,01 | 0,09 |
| 4.169 | FEDEX CORP | USD | 914.220,01 | 0,12 |
| 3.465 | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC | USD | 157.103,10 | 0,02 |
| 10.932 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC | USD | 1.330.205,76 | 0,17 |
| 18.157 | FIFTH THIRD BANCORP | USD | 770.583,08 | 0,10 |
| 1.598 | FIRST REPUBLIC BANK/CA | USD | 308.222,24 | 0,04 |
| 10.710 | FISERV INC | USD | 1.162.035,00 | 0,15 |
| 1.186 | FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | USD | 309.866,22 | 0,04 |
| 7.514 | FMC CORP | USD | 687.981,84 | 0,09 |
| 92.426 | FORD MOTOR CO | USD | 1.308.752,16 | 0,16 |
| 2.178 | FORTINET INC | USD | 636.063,12 | 0,08 |
| 7.083 | FORTIVE CORP | USD | 499.847,31 | 0,07 |
| 5.204 | FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | USD | 465.341,68 | 0,06 |
| 6.396 | FOX CORP - A | USD | 256.543,56 | 0,03 |
| 2.704 | FOX CORP - B | USD | 100.372,48 | 0,01 |
| 8.021 | FRANKLIN RESOURCES INC | USD | 238.384,12 | 0,03 |
| 480 | F5 NETWORKS INC | USD | 95.414,40 | 0,01 |
| 895 | GARTNER INC | USD | 271.972,60 | 0,04 |
| 1.205 | GENERAC HOLDINGS INC | USD | 492.447,35 | 0,06 |
| 14.728 | GENERAL MILLS INC | USD | 881.028,96 | 0,12 |
| 20.429 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 1.426.965,65 | 0,19 |
| 5.738 | GLOBAL PAYMENTS INC | USD | 904.194,04 | 0,12 |
| 1.560 | GLOBE LIFE INC | USD | 138.886,80 | 0,02 |
| 6.561 | GODADDY INC - A | USD | 457.301,70 | 0,06 |
| 4.980 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE | USD | 1.882.589,40 | 0,25 |
| 1.082 | GUIDEWIRE SOFTWARE INC | USD | 128.617,34 | 0,02 |
| 6.529 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 458.662,25 | 0,06 |
| 2.201 | HASBRO INC | USD | 196.373,22 | 0,03 |
| 4.453 | HCA HEALTHCARE INC | USD | 1.080.832,16 | 0,14 |
| 20.129 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | USD | 673.918,92 | 0,09 |
| 2.778 | HENRY SCHEIN INC | USD | 211.572,48 | 0,03 |
| 4.909 | HERSHEY CO/THE | USD | 830.848,25 | 0,11 |
| 35.354 | HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO | USD | 503.794,50 | 0,07 |
| 5.513 | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | USD | 728.322,43 | 0,10 |
| 4.605 | HOLOGIC INC | USD | 339.895,05 | 0,04 |
| 14.904 | HOME DEPOT INC/THE | USD | 4.892.387,04 | 0,64 |
| 18.117 | HOST HOTELS & RESORTS INC | USD | 295.850,61 | 0,04 |
| 22.041 | HP INC | USD | 603.041,76 | 0,08 |
| 783 | HUBSPOT INC | USD | 529.378,47 | 0,07 |
| 1.744 | HUMANA INC | USD | 678.677,60 | 0,09 |
| 26.105 | HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH | USD | 403.583,30 | 0,05 |
| 1.762 | IDEX CORP | USD | 364.645,90 | 0,05 |
| 1.450 | IDEXX LABORATORIES INC | USD | 901.755,00 | 0,12 |
| 6.907 | ILLINOIS TOOL WORKS INC | USD | 1.427.193,41 | 0,19 |
| 2.496 | ILLUMINA INC | USD | 1.012.402,56 | 0,13 |
| 3.519 | INCYTE CORP | USD | 242.036,82 | 0,03 |
| 9.462 | INGERSOLL-RAND PLC | USD | 476.979,42 | 0,06 |
| 1.117 | INSULET CORP | USD | 317.484,91 | 0,04 |
| 64.721 | INTEL CORP | USD | 3.448.334,88 | 0,44 |
| 9.936 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | USD | 1.140.851,52 | 0,15 |
| 14.659 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 2.036.574,87 | 0,27 |
| 6.345 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC | USD | 848.453,40 | 0,11 |
| 12.667 | INTERNATIONAL PAPER CO | USD | 708.338,64 | 0,09 |
| 10.674 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC/THE | USD | 391.415,58 | 0,05 |
| 4.135 | INTUIT INC | USD | 2.230.873,85 | 0,29 |
| 2.090 | INTUITIVE SURGICAL INC | USD | 2.077.773,50 | 0,27 |
| 4.550 | IQVIA HOLDINGS INC | USD | 1.089.907,00 | 0,14 |
| 4.314 | IRON MOUNTAIN INC | USD | 187.443,30 | 0,02 |
| 3.526 | J M SMUCKER CO/THE | USD | 423.225,78 | 0,06 |
| 371 | JACK HENRY & ASSOCIATES INC | USD | 60.866,26 | 0,01 |
| 47.189 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 7.724.367,41 | 1,01 |
| 1.924 | KANSAS CITY SOUTHERN | USD | 520.711,36 | 0,07 |
| 7.488 | KELLOGG CO | USD | 478.632,96 | 0,06 |
| 27.810 | KEURIG DR PEPPER INC | USD | 949.989,60 | 0,12 |
| 17.808 | KEYCORP | USD | 385.008,96 | 0,05 |
| 1.237 | KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | USD | 203.226,73 | 0,03 |
| 83.140 | KINDER MORGAN INC/DE | USD | 1.390.932,20 | 0,17 |
| 3.526 | KLA CORP | USD | 1.179.482,26 | 0,15 |
| 14.667 | KROGER CO/THE | USD | 592.986,81 | 0,08 |
| 1.698 | LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | USD | 477.885,12 | 0,06 |
| 2.801 | LAM RESEARCH CORP | USD | 1.594.189,15 | 0,21 |
| 1.751 | LEAR CORP | USD | 273.996,48 | 0,04 |
| 4.457 | LENNAR CORP - A | USD | 417.531,76 | 0,05 |
| 187 | LENNOX INTERNATIONAL INC | USD | 55.009,79 | 0,01 |
| 220 | LIBERTY BROADBAND CORP - A | USD | 37.037,00 | 0,00 |
| 2.482 | LIBERTY BROADBAND CORP - C | USD | 428.641,40 | 0,06 |
| 1.416 | LIBERTY MEDIA CORP-LIBERTY FORMULA ONE - C | USD | 72.796,56 | 0,01 |
| 3.351 | LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM - C | USD | 159.071,97 | 0,02 |
| 6.285 | LINCOLN NATIONAL CORP | USD | 432.093,75 | 0,06 |
| 3.856 | LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | USD | 351.397,28 | 0,05 |
| 4.552 | LKQ CORP | USD | 229.056,64 | 0,03 |
| 4.554 | LOEWS CORP | USD | 245.597,22 | 0,03 |
| 10.686 | LOWE'S COS INC | USD | 2.167.761,96 | 0,28 |
| 2.069 | LULULEMON ATHLETICA INC | USD | 837.324,30 | 0,11 |
| 5.726 | LYFT INC - A | USD | 306.856,34 | 0,04 |
| 300 | MARKEL CORP | USD | 358.539,00 | 0,05 |
| 691 | MARKETAXESS HOLDINGS INC | USD | 290.696,79 | 0,04 |
| 7.595 | MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A | USD | 1.124.743,55 | 0,15 |
| 10.285 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 1.557.457,55 | 0,20 |
| 3.839 | MASCO CORP | USD | 213.256,45 | 0,03 |
| 10.820 | MASTERCARD INC - A | USD | 3.761.897,60 | 0,49 |
| 6.348 | MATCH GROUP INC | USD | 996.572,52 | 0,13 |
| 3.490 | MCCORMICK & CO INC/MD - NON VOTING | USD | 282.794,70 | 0,04 |
| 12.608 | MCDONALD'S CORP | USD | 3.039.914,88 | 0,40 |
| 763 | MERCADOLIBRE INC | USD | 1.281.382,20 | 0,17 |
| 44.434 | MERCK & CO INC | USD | 3.337.437,74 | 0,44 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 20.309 | METLIFE INC | USD | 1.253.674,57 | 0,16 |
| 487 | METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | USD | 670.774,32 | 0,09 |
| 94.567 | MICROSOFT CORP | USD | 26.660.328,64 | 3,49 |
| 34.490 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A | USD | 2.006.628,20 | 0,26 |
| 1.919 | MONGODB INC - A | USD | 904.827,69 | 0,12 |
| 10.243 | MONSTER BEVERAGE CORP | USD | 909.885,69 | 0,12 |
| 2.911 | MOODY'S CORP | USD | 1.033.725,21 | 0,14 |
| 26.045 | MORGAN STANLEY | USD | 2.534.438,95 | 0,33 |
| 2.195 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | USD | 509.942,40 | 0,07 |
| 1.371 | MSCI INC -A | USD | 834.034,14 | 0,11 |
| 1.354 | M&T BANK CORP | USD | 202.206,36 | 0,03 |
| 1.882 | NASDAQ INC | USD | 363.263,64 | 0,05 |
| 4.255 | NETAPP INC | USD | 381.928,80 | 0,05 |
| 6.328 | NETFLIX INC | USD | 3.862.231,52 | 0,51 |
| 2.128 | NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | USD | 204.096,48 | 0,03 |
| 8.444 | NEWELL BRANDS INC | USD | 186.950,16 | 0,02 |
| 9.552 | NEWS CORP - A | USD | 224.758,56 | 0,03 |
| 19.013 | NIKE INC - B | USD | 2.761.257,99 | 0,36 |
| 1.904 | NORDSON CORP | USD | 453.437,60 | 0,06 |
| 5.220 | NORFOLK SOUTHERN CORP | USD | 1.248.885,00 | 0,16 |
| 4.305 | NORTHERN TRUST CORP | USD | 464.122,05 | 0,06 |
| 6.364 | NORTONLIFELOCK INC | USD | 161.009,20 | 0,02 |
| 36.126 | NVIDIA CORP | USD | 7.483.862,16 | 0,98 |
| 37 | NVR INC | USD | 177.380,96 | 0,02 |
| 3.680 | OKTA INC - A | USD | 873.411,20 | 0,11 |
| 4.136 | OMNICOM GROUP INC | USD | 299.694,56 | 0,04 |
| 19.362 | ON SEMICONDUCTOR CORP | USD | 886.198,74 | 0,12 |
| 15.152 | ONEOK INC | USD | 878.664,48 | 0,12 |
| 28.020 | ORACLE CORP | USD | 2.441.382,60 | 0,32 |
| 2.222 | OWENS CORNING | USD | 189.981,00 | 0,02 |
| 7.587 | PACCAR INC | USD | 598.766,04 | 0,08 |
| 3.085 | PACKAGING CORP OF AMERICA | USD | 424.002,40 | 0,06 |
| 1.611 | PALO ALTO NETWORKS INC | USD | 771.669,00 | 0,10 |
| 3.379 | PAYCHEX INC | USD | 379.968,55 | 0,05 |
| 1.074 | PAYCOM SOFTWARE INC | USD | 532.435,50 | 0,07 |
| 15.771 | PAYPAL HOLDINGS INC | USD | 4.103.771,91 | 0,54 |
| 17.629 | PEPSICO INC | USD | 2.651.577,89 | 0,35 |
| 2.680 | PERKINELMER INC | USD | 464.417,20 | 0,06 |
| 86.733 | PFIZER INC | USD | 3.730.386,33 | 0,48 |
| 14.154 | PINTEREST INC - A | USD | 721.146,30 | 0,09 |
| 8.407 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 1.644.745,48 | 0,22 |
| 715 | POOL CORP | USD | 310.603,15 | 0,04 |
| 1.371 | PPD INC | USD | 64.149,09 | 0,01 |
| 4.749 | PPG INDUSTRIES INC | USD | 679.154,49 | 0,09 |
| 6.383 | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC | USD | 411.065,20 | 0,05 |
| 38.283 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | USD | 5.351.963,40 | 0,70 |
| 10.152 | PROGRESSIVE CORP/THE | USD | 917.639,28 | 0,12 |
| 13.616 | PROLOGIS INC | USD | 1.707.854,88 | 0,22 |
| 12.428 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | USD | 1.307.425,60 | 0,17 |
| 1.415 | PTC INC | USD | 169.502,85 | 0,02 |
| 3.703 | PUBLIC STORAGE | USD | 1.100.161,30 | 0,14 |
| 1.973 | PULTEGROUP INC | USD | 90.600,16 | 0,01 |
| 5.584 | QORVO INC | USD | 933.588,96 | 0,12 |
| 1.998 | QUEST DIAGNOSTICS INC | USD | 290.329,38 | 0,04 |
| 2.986 | RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | USD | 275.548,08 | 0,04 |
| 11.495 | REALTY INCOME CORP | USD | 745.565,70 | 0,10 |
| 6.986 | REGENCY CENTERS CORP | USD | 470.367,38 | 0,06 |
| 1.584 | REGENERON PHARMACEUTICALS INC | USD | 958.605,12 | 0,13 |
| 15.193 | REGIONS FINANCIAL CORP | USD | 323.762,83 | 0,04 |
| 4.635 | REPUBLIC SERVICES INC - A | USD | 556.478,10 | 0,07 |
| 2.764 | RESMED INC | USD | 728.452,20 | 0,10 |
| 1.271 | RINGCENTRAL INC - A | USD | 276.442,50 | 0,04 |
| 1.837 | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | USD | 184.306,21 | 0,02 |
| 3.481 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 1.023.553,24 | 0,13 |
| 1.947 | ROKU INC - A | USD | 610.092,45 | 0,08 |
| 4.581 | ROLLINS INC | USD | 161.846,73 | 0,02 |
| 2.671 | ROPER TECHNOLOGIES INC | USD | 1.191.613,23 | 0,16 |
| 6.071 | ROSS STORES INC | USD | 660.828,35 | 0,09 |
| 6.119 | RPM INTERNATIONAL INC | USD | 475.140,35 | 0,06 |
| 13.962 | SALESFORCE.COM INC | USD | 3.786.773,64 | 0,50 |
| 987 | SBA COMMUNICATIONS CORP - A | USD | 326.272,59 | 0,04 |
| 3.078 | SERVICENOW INC | USD | 1.915.347,06 | 0,25 |
| 5.654 | SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | USD | 1.581.593,42 | 0,21 |
| 6.161 | SIMON PROPERTY GROUP INC | USD | 800.745,17 | 0,11 |
| 18.805 | SIRIUS XM HOLDINGS INC | USD | 114.710,50 | 0,02 |
| 19.776 | SNAP INC - A | USD | 1.460.853,12 | 0,19 |
| 1.051 | SNAP-ON INC | USD | 219.606,45 | 0,03 |
| 3.103 | SNOWFLAKE INC - A | USD | 938.440,29 | 0,12 |
| 772 | SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | USD | 204.749,84 | 0,03 |
| 9.658 | SOUTHWEST AIRLINES CO | USD | 496.710,94 | 0,07 |
| 3.901 | S&P GLOBAL INC | USD | 1.657.495,89 | 0,22 |
| 2.987 | SPLUNK INC | USD | 432.248,77 | 0,06 |
| 6.278 | SQUARE INC - A | USD | 1.505.715,52 | 0,20 |
| 4.048 | STANLEY BLACK & DECKER INC | USD | 709.654,88 | 0,09 |
| 23.023 | STARBUCKS CORP | USD | 2.539.667,13 | 0,33 |
| 7.995 | STATE STREET CORP | USD | 677.336,40 | 0,09 |
| 4.573 | STRYKER CORP | USD | 1.205.991,56 | 0,16 |
| 5.200 | SUNRUN INC | USD | 228.800,00 | 0,03 |
| 654 | SVB FINANCIAL GROUP | USD | 423.059,52 | 0,06 |
| 16.169 | SYNCHRONY FINANCIAL | USD | 790.340,72 | 0,10 |
| 2.650 | SYNOPSYS INC | USD | 793.436,50 | 0,10 |
| 10.153 | SYSCO CORP | USD | 797.010,50 | 0,10 |
| 2.338 | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | USD | 360.215,66 | 0,05 |
| 7.727 | TARGET CORP | USD | 1.767.705,79 | 0,23 |
| 2.235 | TELADOC HEALTH INC | USD | 283.420,35 | 0,04 |
| 1.029 | TELEFLEX INC | USD | 387.469,95 | 0,05 |
| 2.068 | TERADYNE INC | USD | 225.763,56 | 0,03 |
| 10.964 | TESLA INC | USD | 8.502.362,72 | 1,12 |
| 20.321 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 3.905.899,41 | 0,51 |
| 6.204 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 3.544.531,32 | 0,47 |
| 21.417 | TJX COS INC/THE | USD | 1.413.093,66 | 0,19 |
| 10.940 | T-MOBILE US INC | USD | 1.397.694,40 | 0,18 |
| 1.781 | TRACTOR SUPPLY CO | USD | 360.848,41 | 0,05 |
| 7.658 | TRADE DESK INC/THE - A | USD | 538.357,40 | 0,07 |
| 4.274 | TRANSUNION | USD | 480.012,94 | 0,06 |
| 5.530 | TRAVELERS COS INC/THE | USD | 840.615,30 | 0,11 |
| 2.834 | TRIMBLE INC | USD | 233.096,50 | 0,03 |
| 17.583 | TRUIST FINANCIAL CORP | USD | 1.031.242,95 | 0,14 |
| 3.919 | TWILIO INC - A | USD | 1.250.356,95 | 0,16 |
| 17.960 | TWITTER INC | USD | 1.084.604,40 | 0,14 |
| 470 | TYLER TECHNOLOGIES INC/THE | USD | 215.565,50 | 0,03 |
| 37.055 | UGI CORP | USD | 1.579.284,10 | 0,21 |
| 12.009 | UNION PACIFIC CORP | USD | 2.353.884,09 | 0,31 |
| 11.220 | UNITED PARCEL SERVICE INC - B | USD | 2.043.162,00 | 0,27 |
| 1.651 | UNITED RENTALS INC | USD | 579.385,43 | 0,08 |
| 13.173 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 5.147.218,02 | 0,68 |
| 1.450 | UNITY SOFTWARE INC | USD | 183.062,50 | 0,02 |
| 29.509 | US BANCORP | USD | 1.754.014,96 | 0,23 |
| 830 | VAIL RESORTS INC | USD | 277.261,50 | 0,04 |
| 9.426 | VENTAS INC | USD | 520.409,46 | 0,07 |
| 9.909 | VEREIT INC | USD | 448.184,07 | 0,06 |
| 1.600 | VERISIGN INC | USD | 328.016,00 | 0,04 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 4.062 | VERISK ANALYTICS INC - A | USD | 813.496,74 | 0,11 |
| 70.780 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 3.822.827,80 | 0,49 |
| 4.989 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 904.954,71 | 0,12 |
| 7.148 | VF CORP | USD | 478.844,52 | 0,06 |
| 10.512 | VIACOMCBS INC - B | USD | 415.329,12 | 0,05 |
| 23.574 | VISA INC - A | USD | 5.251.108,50 | 0,69 |
| 1.631 | VMWARE INC - A | USD | 242.529,70 | 0,03 |
| 9.276 | VORNADO REALTY TRUST | USD | 389.684,76 | 0,05 |
| 3.696 | VOYA FINANCIAL INC | USD | 226.897,44 | 0,03 |
| 666 | W R BERKLEY CORP | USD | 48.737,88 | 0,01 |
| 19.321 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | USD | 909.053,05 | 0,12 |
| 27.003 | WALT DISNEY CO/THE | USD | 4.568.097,51 | 0,60 |
| 8.959 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 1.338.116,24 | 0,18 |
| 1.365 | WATERS CORP | USD | 487.714,50 | 0,06 |
| 1.190 | WAYFAIR INC - A | USD | 304.056,90 | 0,04 |
| 5.163 | WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP | USD | 445.102,23 | 0,06 |
| 23.113 | WEYERHAEUSER CO | USD | 822.129,41 | 0,11 |
| 198 | WHIRLPOOL CORP | USD | 40.364,28 | 0,01 |
| 3.069 | WORKDAY INC - A | USD | 766.912,41 | 0,10 |
| 894 | WW GRAINGER INC | USD | 351.395,64 | 0,05 |
| 8.155 | XILINX INC | USD | 1.231.323,45 | 0,16 |
| 4.064 | XYLEM INC/NY | USD | 502.635,52 | 0,07 |
| 6.071 | YUM! BRANDS INC | USD | 742.544,01 | 0,10 |
| 923 | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A | USD | 475.732,66 | 0,06 |
| 1.729 | ZENDESK INC | USD | 201.238,31 | 0,03 |
| 4.254 | ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | USD | 622.615,44 | 0,08 |
| 8.625 | ZOETIS INC - A | USD | 1.674.457,50 | 0,22 |
| 3.055 | ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC - A | USD | 798.882,50 | 0,10 |
| 1.001 | ZSCALER INC | USD | 262.482,22 | 0,03 |
| 1.690 | 10X GENOMICS INC - A | USD | 246.030,20 | 0,03 |
| 8.190 | 3M CO | USD | 1.436.689,80 | 0,19 |
| | | | **483.077.051,20** | **63,38** |
| | **Japan** | | | |
| 4.000 | ADVANTEST CORP | JPY | 358.508,29 | 0,05 |
| 14.400 | AEON CO LTD | JPY | 378.310,25 | 0,05 |
| 7.100 | AGC INC | JPY | 366.711,45 | 0,05 |
| 8.900 | AISIN CORP | JPY | 323.685,09 | 0,04 |
| 19.100 | AJINOMOTO CO INC | JPY | 564.253,81 | 0,07 |
| 11.300 | ANA HOLDINGS INC | JPY | 293.384,80 | 0,04 |
| 18.900 | ASAHI GROUP HOLDINGS LTD | JPY | 915.544,58 | 0,12 |
| 50.700 | ASTELLAS PHARMA INC | JPY | 834.744,83 | 0,11 |
| 3.400 | BANDAI NAMCO HOLDINGS INC | JPY | 255.209,29 | 0,03 |
| 3.500 | CASIO COMPUTER CO LTD | JPY | 58.078,88 | 0,01 |
| 4.300 | CONCORDIA FINANCIAL GROUP LTD | JPY | 16.983,57 | 0,00 |
| 13.200 | DAI NIPPON PRINTING CO LTD | JPY | 319.537,05 | 0,04 |
| 2.300 | DAIFUKU CO LTD | JPY | 216.213,03 | 0,03 |
| 30.600 | DAIICHI SANKYO CO LTD | JPY | 814.710,10 | 0,11 |
| 5.400 | DAIKIN INDUSTRIES LTD | JPY | 1.180.289,37 | 0,15 |
| 17.200 | DENSO CORP | JPY | 1.128.907,95 | 0,15 |
| 12.300 | EAST JAPAN RAILWAY CO | JPY | 861.926,50 | 0,11 |
| 5.300 | EISAI CO LTD | JPY | 397.636,81 | 0,05 |
| 4.300 | FANUC CORP | JPY | 943.894,61 | 0,12 |
| 1.100 | FAST RETAILING CO LTD | JPY | 810.736,30 | 0,11 |
| 6.400 | FUJI ELECTRIC CO LTD | JPY | 292.239,66 | 0,04 |
| 3.300 | FUJITSU LTD | JPY | 598.910,80 | 0,08 |
| 15.000 | HINO MOTORS LTD | JPY | 140.874,46 | 0,02 |
| 3.100 | HITACHI CONSTRUCTION MACHINERY CO LTD | JPY | 87.951,59 | 0,01 |
| 21.800 | HITACHI LTD | JPY | 1.293.489,34 | 0,17 |
| 2.900 | IBIDEN CO LTD | JPY | 160.667,48 | 0,02 |
| 7.100 | IDEMITSU KOSAN CO LTD | JPY | 186.908,64 | 0,02 |
| 43.200 | ITOCHU CORP | JPY | 1.265.023,14 | 0,17 |
| 47.300 | JAPAN POST BANK CO LTD | JPY | 405.761,33 | 0,05 |
| 52.100 | JFE HOLDINGS INC | JPY | 790.055,94 | 0,10 |
| 11.000 | KAJIMA CORP | JPY | 141.741,24 | 0,02 |
| 13.100 | KAO CORP | JPY | 779.036,20 | 0,10 |
| 37.500 | KDDI CORP | JPY | 1.236.840,21 | 0,16 |
| 29.100 | KIRIN HOLDINGS CO LTD | JPY | 539.571,96 | 0,07 |
| 2.000 | KOEI TECMO HOLDINGS CO LTD | JPY | 95.077,97 | 0,01 |
| 23.900 | KOMATSU LTD | JPY | 575.565,76 | 0,08 |
| 300 | KOSE CORP | JPY | 35.868,70 | 0,00 |
| 25.700 | KUBOTA CORP | JPY | 548.640,11 | 0,07 |
| 1.600 | KURITA WATER INDUSTRIES LTD | JPY | 77.206,18 | 0,01 |
| 1.300 | KYOWA KIRIN CO LTD | JPY | 46.757,10 | 0,01 |
| 76.200 | MARUBENI CORP | JPY | 635.430,39 | 0,07 |
| 51.400 | MAZDA MOTOR CORP | JPY | 448.281,92 | 0,06 |
| 6.600 | MEIJI HOLDINGS CO LTD | JPY | 425.223,71 | 0,06 |
| 1.900 | MERCARI INC | JPY | 104.585,77 | 0,01 |
| 23.500 | MINEBEA MITSUMI INC | JPY | 601.421,79 | 0,08 |
| 78.900 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS CORP | JPY | 721.610,98 | 0,08 |
| 65.300 | MITSUBISHI ELECTRIC CORP | JPY | 908.531,68 | 0,12 |
| 25.400 | MITSUBISHI ESTATE CO LTD | JPY | 404.123,38 | 0,05 |
| 346.700 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC | JPY | 2.038.224,46 | 0,26 |
| 10.500 | MITSUI CHEMICALS INC | JPY | 353.258,45 | 0,05 |
| 70.320 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC | JPY | 995.656,17 | 0,13 |
| 6.400 | MONOTARO CO LTD | JPY | 144.346,95 | 0,02 |
| 9.300 | MURATA MANUFACTURING CO LTD | JPY | 827.714,51 | 0,11 |
| 1.300 | NABTESCO CORP | JPY | 49.370,84 | 0,01 |
| 12.400 | NEXON CO LTD | JPY | 200.224,92 | 0,03 |
| 3.900 | NH FOODS LTD | JPY | 147.415,53 | 0,02 |
| 8.200 | NIDEC CORP | JPY | 910.067,76 | 0,12 |
| 29.900 | NIPPON PAINT HOLDINGS CO LTD | JPY | 325.162,20 | 0,04 |
| 76 | NIPPON PROLOGIS REIT INC | JPY | 252.975,32 | 0,03 |
| 45.900 | NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE CORP | JPY | 1.265.336,79 | 0,17 |
| 4.800 | NIPPON YUSEN KK | JPY | 362.440,09 | 0,05 |
| 3.600 | NISSIN FOODS HOLDINGS CO LTD | JPY | 288.236,38 | 0,04 |
| 2.000 | NITORI HOLDINGS CO LTD | JPY | 395.145,48 | 0,05 |
| 74.600 | NOMURA HOLDINGS INC | JPY | 369.039,78 | 0,04 |
| 4.300 | NOMURA RESEARCH INSTITUTE LTD | JPY | 159.076,88 | 0,02 |
| 12.300 | NSK LTD | JPY | 83.642,70 | 0,01 |
| 10.000 | NTT DATA CORP | JPY | 193.462,23 | 0,03 |
| 1.200 | OMRON CORP | JPY | 119.026,18 | 0,02 |
| 500 | ORACLE CORP JAPAN | JPY | 43.875,27 | 0,01 |
| 41.200 | ORIX CORP | JPY | 776.815,62 | 0,10 |
| 22 | ORIX JREIT INC | JPY | 38.138,42 | 0,01 |
| 8.500 | OSAKA SECURITIES EXCHANGE CO LTD | JPY | 210.775,53 | 0,03 |
| 58.600 | PANASONIC CORP | JPY | 727.864,76 | 0,10 |
| 4.900 | PERSOL HOLDINGS CO LTD | JPY | 123.038,40 | 0,02 |
| 2.100 | POLA ORBIS HOLDINGS INC | JPY | 48.377,17 | 0,01 |
| 26.000 | RAKUTEN GROUP INC | JPY | 251.152,39 | 0,03 |
| 19.900 | RECRUIT HOLDINGS CO LTD | JPY | 1.214.896,32 | 0,16 |
| 64.600 | RESONA HOLDINGS INC | JPY | 259.073,89 | 0,03 |
| 21.200 | RICOH CO LTD | JPY | 217.478,35 | 0,03 |
| 800 | RINNAI CORP | JPY | 87.643,31 | 0,01 |
| 2.100 | ROHM CO LTD | JPY | 199.663,74 | 0,03 |
| 13.200 | SANTEN PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 185.895,31 | 0,02 |
| 8.300 | SEIKO EPSON CORP | JPY | 167.545,44 | 0,02 |
| 13.800 | SEKISUI CHEMICAL CO LTD | JPY | 237.628,81 | 0,03 |
| 18.600 | SEKISUI HOUSE LTD | JPY | 390.837,48 | 0,05 |
| 4.800 | SHARP CORP/JAPAN | JPY | 60.778,42 | 0,01 |
| 3.200 | SHIONOGI & CO LTD | JPY | 218.865,20 | 0,03 |
| 8.900 | SHISEIDO CO LTD | JPY | 599.413,89 | 0,08 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 62.000 | SOFTBANK CORP | JPY | 839.072,04 | 0,11 |
| 4.100 | SOMPO HOLDINGS INC | JPY | 178.826,12 | 0,02 |
| 21.600 | SONY GROUP CORP | JPY | 2.404.007,21 | 0,32 |
| 3.700 | SQUARE ENIX HOLDINGS CO LTD | JPY | 196.723,83 | 0,03 |
| 15.000 | STANLEY ELECTRIC CO LTD | JPY | 378.524,71 | 0,05 |
| 56.200 | SUBARU CORP | JPY | 1.043.817,63 | 0,14 |
| 41.300 | SUMITOMO CORP | JPY | 583.656,77 | 0,08 |
| 6.600 | SUMITOMO DAINIPPON PHARMA CO LTD | JPY | 117.835,92 | 0,02 |
| 30.700 | SUMITOMO METAL MINING CO LTD | JPY | 1.115.160,06 | 0,15 |
| 22.000 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | JPY | 775.350,14 | 0,10 |
| 10.300 | SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | JPY | 354.997,37 | 0,05 |
| 12.900 | SUNTORY BEVERAGE & FOOD LTD | JPY | 534.867,21 | 0,07 |
| 4.500 | TAISEI CORP | JPY | 144.761,58 | 0,02 |
| 33.500 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 1.107.305,41 | 0,15 |
| 15.100 | TERUMO CORP | JPY | 713.116,07 | 0,09 |
| 2.600 | TOKYO ELECTRON LTD | JPY | 1.153.999,95 | 0,15 |
| 8.200 | TOYOTA TSUSHO CORP | JPY | 348.419,66 | 0,05 |
| 3.700 | WELCIA HOLDINGS CO LTD | JPY | 132.581,94 | 0,02 |
| 115.800 | YAHOO JAPAN CORP | JPY | 742.659,58 | 0,09 |
| 2.400 | YAMAHA CORP | JPY | 151.195,42 | 0,02 |
| 12.000 | YAMAHA MOTOR CO LTD | JPY | 334.560,08 | 0,04 |
| 7.700 | YAMATO HOLDINGS CO LTD | JPY | 194.722,19 | 0,03 |
| 3.300 | YASKAWA ELECTRIC CORP | JPY | 159.237,73 | 0,02 |
| | | | **53.831.643,95** | **7,06** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 43.819 | ABRDN PLC | GBP | 151.017,03 | 0,02 |
| 7.409 | ASHTEAD GROUP PLC | GBP | 564.031,15 | 0,07 |
| 14.044 | ASSOCIATED BRITISH FOODS PLC | GBP | 352.213,82 | 0,05 |
| 25.650 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 3.098.079,70 | 0,41 |
| 28.702 | AUTO TRADER GROUP PLC | GBP | 227.867,61 | 0,03 |
| 10.083 | AVIVA PLC | GBP | 53.824,24 | 0,01 |
| 269.615 | BARCLAYS PLC | GBP | 689.263,07 | 0,09 |
| 4.278 | BARRATT DEVELOPMENTS PLC | GBP | 38.093,46 | 0,00 |
| 258 | BERKELEY GROUP HOLDINGS PLC | GBP | 15.174,28 | 0,00 |
| 704.026 | BP PLC | GBP | 3.230.377,47 | 0,41 |
| 22.383 | BRITISH LAND CO PLC/THE | GBP | 149.451,94 | 0,02 |
| 116.263 | BT GROUP PLC | GBP | 250.507,61 | 0,03 |
| 2.772 | BUNZL PLC | GBP | 91.758,72 | 0,01 |
| 3.259 | BURBERRY GROUP PLC | GBP | 79.756,05 | 0,01 |
| 4.570 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC | USD | 252.675,30 | 0,03 |
| 35.352 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 726.443,06 | 0,10 |
| 4.119 | CRODA INTERNATIONAL PLC | GBP | 474.521,24 | 0,06 |
| 43.456 | DIAGEO PLC | GBP | 2.112.895,87 | 0,28 |
| 89.243 | GLAXOSMITHKLINE PLC | GBP | 1.688.963,04 | 0,22 |
| 3.003 | HARGREAVES LANSDOWN PLC | GBP | 57.962,80 | 0,01 |
| 328.802 | HSBC HOLDINGS PLC | GBP | 1.729.248,30 | 0,23 |
| 56.798 | INFORMA PLC | GBP | 420.750,19 | 0,06 |
| 3.939 | INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | GBP | 252.598,32 | 0,03 |
| 1.610 | INTERTEK GROUP PLC | GBP | 108.042,88 | 0,01 |
| 17.829 | J SAINSBURY PLC | GBP | 68.609,40 | 0,01 |
| 8.050 | JOHNSON MATTHEY PLC | GBP | 291.435,73 | 0,04 |
| 11.499 | KINGFISHER PLC | GBP | 52.173,24 | 0,01 |
| 14.805 | LAND SECURITIES GROUP PLC | GBP | 139.137,38 | 0,02 |
| 60.215 | LEGAL & GENERAL GROUP PLC | GBP | 228.227,61 | 0,03 |
| 13.138 | LIBERTY GLOBAL PLC - C | USD | 387.045,48 | 0,05 |
| 1.578.700 | LLOYDS BANKING GROUP PLC | GBP | 991.307,68 | 0,12 |
| 5.945 | LONDON STOCK EXCHANGE GROUP PLC | GBP | 597.187,57 | 0,08 |
| 65.705 | M&G PLC | GBP | 180.376,03 | 0,02 |
| 16.707 | MONDI PLC | GBP | 412.129,33 | 0,05 |
| 114.601 | NATWEST GROUP PLC | GBP | 347.520,55 | 0,05 |
| 360 | NEXT PLC | GBP | 39.861,54 | 0,01 |
| 185 | NMC HEALTH PLC | GBP | 2.340,79 | 0,00 |
| 19.707 | PEARSON PLC | GBP | 189.139,02 | 0,02 |
| 1.723 | PERSIMMON PLC | GBP | 61.983,16 | 0,01 |
| 46.420 | PRUDENTIAL PLC | GBP | 910.690,39 | 0,12 |
| 11.037 | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | GBP | 867.605,35 | 0,11 |
| 35.554 | RELX PLC | GBP | 1.029.255,36 | 0,14 |
| 15.227 | RENTOKIL INITIAL PLC | GBP | 119.820,81 | 0,02 |
| 789 | SCHRODERS PLC | GBP | 38.245,34 | 0,01 |
| 18.792 | SEGRO PLC | GBP | 302.791,40 | 0,04 |
| 5.745 | SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | USD | 314.366,40 | 0,04 |
| 11.303 | SMITH & NEPHEW PLC | GBP | 196.143,94 | 0,03 |
| 197 | SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | GBP | 39.764,05 | 0,01 |
| 35.826 | STANDARD CHARTERED PLC | GBP | 210.614,10 | 0,03 |
| 50.283 | TAYLOR WIMPEY PLC | GBP | 105.630,96 | 0,01 |
| 213.721 | TESCO PLC | GBP | 729.936,38 | 0,10 |
| 40.709 | UNILEVER PLC | GBP | 2.198.343,63 | 0,29 |
| 100.662 | UNITED UTILITIES GROUP PLC | GBP | 1.314.386,11 | 0,17 |
| 409.718 | VODAFONE GROUP PLC | GBP | 625.918,19 | 0,08 |
| 5.862 | WHITBREAD PLC | GBP | 262.097,55 | 0,03 |
| 47.385 | WM MORRISON SUPERMARKETS PLC | GBP | 188.160,66 | 0,02 |
| 24.425 | 3I GROUP PLC | GBP | 422.042,14 | 0,06 |
| | | | **30.679.804,42** | **4,02** |
| | **Kanada** | | | |
| 9.961 | BALLARD POWER SYSTEMS INC | CAD | 139.800,75 | 0,02 |
| 11.895 | BANK OF MONTREAL | CAD | 1.187.293,48 | 0,16 |
| 24.334 | BANK OF NOVA SCOTIA/THE | CAD | 1.497.476,92 | 0,20 |
| 17.888 | BCE INC | CAD | 895.917,91 | 0,12 |
| 15.480 | BLACKBERRY LTD | CAD | 150.663,77 | 0,02 |
| 7.790 | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | CAD | 867.024,51 | 0,11 |
| 15.009 | CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO | CAD | 1.738.975,43 | 0,23 |
| 13.923 | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | CAD | 909.003,69 | 0,12 |
| 291 | CANADIAN TIRE CORP LTD - A | CAD | 40.712,67 | 0,01 |
| 7.502 | CCL INDUSTRIES INC - B | CAD | 388.468,41 | 0,05 |
| 532 | CGI INC | CAD | 45.181,26 | 0,01 |
| 2.390 | EMPIRE CO LTD - A | CAD | 72.821,57 | 0,01 |
| 319 | FAIRFAX FINANCIAL HOLDINGS LTD | CAD | 128.750,75 | 0,02 |
| 1.460 | GEORGE WESTON LTD | CAD | 157.449,74 | 0,02 |
| 2.759 | GILDAN ACTIVEWEAR INC - A | CAD | 100.790,56 | 0,01 |
| 97.640 | HYDRO ONE LTD | CAD | 2.307.567,27 | 0,30 |
| 1.397 | INTACT FINANCIAL CORP | CAD | 184.686,08 | 0,02 |
| 21.908 | KEYERA CORP | CAD | 551.137,04 | 0,07 |
| 37.502 | KIRKLAND LAKE GOLD LTD | CAD | 1.561.830,93 | 0,20 |
| 4.958 | LOBLAW COS LTD | CAD | 340.173,94 | 0,04 |
| 128.979 | LUNDIN MINING CORP | CAD | 927.496,30 | 0,11 |
| 35.167 | MANULIFE FINANCIAL CORP | CAD | 676.774,25 | 0,09 |
| 3.339 | METRO INC | CAD | 163.121,69 | 0,02 |
| 1.331 | NATIONAL BANK OF CANADA | CAD | 102.206,01 | 0,01 |
| 23.136 | PEMBINA PIPELINE CORP | CAD | 733.244,19 | 0,10 |
| 2.164 | QUEBECOR INC - B | CAD | 52.287,20 | 0,01 |
| 6.707 | RESTAURANT BRANDS INTERNATIONAL INC | CAD | 410.832,54 | 0,05 |
| 7.034 | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | CAD | 120.152,95 | 0,02 |
| 2.117 | RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC | CAD | 130.611,14 | 0,02 |
| 10.729 | ROGERS COMMUNICATIONS INC - B | CAD | 500.943,56 | 0,07 |
| 29.845 | ROYAL BANK OF CANADA | CAD | 2.969.069,23 | 0,39 |
| 31.340 | SHAW COMMUNICATIONS INC - B | CAD | 910.872,48 | 0,12 |
| 1.958 | SHOPIFY INC - A | CAD | 2.657.167,59 | 0,35 |
| 6.367 | SUN LIFE FINANCIAL INC | CAD | 327.685,52 | 0,04 |
| 22.298 | TELUS CORP | CAD | 490.015,65 | 0,06 |
| 5.317 | THOMSON REUTERS CORP | CAD | 587.793,23 | 0,08 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 31.119 | TORONTO-DOMINION BANK/THE | CAD | 2.059.697,79 | 0,27 |
| 2.281 | WSP GLOBAL INC | CAD | 273.068,21 | 0,04 |
| | | | **27.358.766,21** | **3,59** |
| | **Schweiz** | | | |
| 40.915 | ABB LTD - REG | CHF | 1.376.772,10 | 0,18 |
| 541 | ADECCO GROUP AG - REG | CHF | 27.268,93 | 0,00 |
| 3.191 | ALCON INC | CHF | 260.110,03 | 0,03 |
| 21 | BARRY CALLEBAUT AG - REG | CHF | 47.724,71 | 0,01 |
| 31 | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG | CHF | 346.272,18 | 0,05 |
| 4 | CHOCOLADEFABRIKEN LINDT & SPRUENGLI AG | CHF | 471.244,04 | 0,06 |
| 8.177 | CHUBB LTD | USD | 1.418.545,96 | 0,19 |
| 10.565 | CIE FINANCIERE RICHEMONT SA - REG | CHF | 1.103.330,97 | 0,14 |
| 10.738 | CLARIANT AG - REG | CHF | 202.880,69 | 0,03 |
| 6.748 | COCA-COLA HBC AG -DI | GBP | 218.276,99 | 0,03 |
| 282 | EMS-CHEMIE HOLDING AG - REG | CHF | 267.232,67 | 0,04 |
| 4.610 | GARMIN LTD | USD | 716.670,60 | 0,09 |
| 757 | GEBERIT AG - REG | CHF | 559.117,76 | 0,07 |
| 198 | GIVAUDAN SA - REG | CHF | 904.621,32 | 0,12 |
| 1.216 | KUEHNE + NAGEL INTERNATIONAL AG - REG | CHF | 416.348,18 | 0,05 |
| 1.125 | LOGITECH INTERNATIONAL SA - REG | CHF | 100.410,03 | 0,01 |
| 45.450 | NESTLE SA - REG | CHF | 5.490.931,02 | 0,72 |
| 383 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 602.100,55 | 0,08 |
| 11.356 | ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN | CHF | 4.162.710,19 | 0,55 |
| 1.337 | SCHINDLER HOLDING AG - REG | CHF | 345.984,67 | 0,05 |
| 99 | SGS SA - REG | CHF | 289.300,53 | 0,04 |
| 3.074 | SIKA AG - REG | CHF | 978.038,48 | 0,13 |
| 968 | SONOVA HOLDING AG - REG | CHF | 368.584,02 | 0,05 |
| 225 | STRAUMANN HOLDING AG - REG | CHF | 406.054,03 | 0,05 |
| 3.091 | SWISS RE AG | CHF | 265.544,02 | 0,03 |
| 350 | SWISSCOM AG - REG | CHF | 201.629,42 | 0,03 |
| 5.598 | TE CONNECTIVITY LTD | USD | 768.157,56 | 0,10 |
| 75.428 | UBS GROUP AG - REG | CHF | 1.212.863,80 | 0,16 |
| 1.215 | VIFOR PHARMA AG | CHF | 158.248,91 | 0,02 |
| 2.418 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 994.312,91 | 0,13 |
| | | | **24.681.287,27** | **3,24** |
| | **Frankreich** | | | |
| 568 | AEROPORTS DE PARIS | EUR | 72.806,16 | 0,01 |
| 1.917 | ALSTOM SA | EUR | 72.983,08 | 0,01 |
| 188 | ARKEMA SA | EUR | 24.947,56 | 0,00 |
| 31.043 | AXA SA | EUR | 866.512,90 | 0,11 |
| 209 | BIOMERIEUX | EUR | 23.873,26 | 0,00 |
| 17.829 | BNP PARIBAS SA | EUR | 1.145.552,24 | 0,15 |
| 40.283 | BOLLORE SA | EUR | 233.663,35 | 0,03 |
| 1.072 | CAPGEMINI SE | EUR | 223.817,35 | 0,03 |
| 8.043 | CARREFOUR SA | EUR | 144.901,71 | 0,02 |
| 2.789 | CIE GENERALE DES ETABLISSEMENTS MICHELIN SCA | EUR | 429.250,97 | 0,06 |
| 8.310 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 560.902,12 | 0,07 |
| 938 | COVIVIO | EUR | 79.162,26 | 0,01 |
| 15.065 | CREDIT AGRICOLE SA | EUR | 208.572,16 | 0,03 |
| 11.723 | DANONE SA | EUR | 802.275,19 | 0,11 |
| 5.111 | ESSILORLUXOTTICA SA | EUR | 980.321,60 | 0,13 |
| 811 | GECINA SA | EUR | 109.546,33 | 0,01 |
| 507 | HERMES INTERNATIONAL | EUR | 703.048,61 | 0,09 |
| 128 | IPSEN SA | EUR | 12.247,41 | 0,00 |
| 1.077 | KERING SA | EUR | 768.884,50 | 0,10 |
| 5.849 | KLEPIERRE SA | EUR | 131.777,90 | 0,02 |
| 2.586 | LEGRAND SA | EUR | 278.005,86 | 0,04 |
| 3.678 | L'OREAL SA | EUR | 1.521.115,24 | 0,20 |
| 3.956 | LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | EUR | 2.843.038,28 | 0,37 |
| 4.223 | PERNOD RICARD SA | EUR | 933.332,67 | 0,12 |
| 3.301 | PUBLICIS GROUPE SA | EUR | 222.884,93 | 0,03 |
| 95 | REMY COINTREAU SA | EUR | 18.441,79 | 0,00 |
| 495 | SARTORIUS STEDIM BIOTECH | EUR | 277.489,13 | 0,04 |
| 9.943 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 1.658.222,97 | 0,22 |
| 15.112 | SOCIETE GENERALE SA | EUR | 476.294,65 | 0,06 |
| 899 | SODEXO SA | EUR | 78.954,88 | 0,01 |
| 36.216 | SUEZ SA | EUR | 826.229,30 | 0,11 |
| 256 | TELEPERFORMANCE | EUR | 100.904,68 | 0,01 |
| 66.067 | TOTALENERGIES SE | EUR | 3.164.952,69 | 0,42 |
| 2.341 | UBISOFT ENTERTAINMENT SA | EUR | 140.755,73 | 0,02 |
| 4.580 | VALEO | EUR | 128.718,78 | 0,02 |
| 37.429 | VEOLIA ENVIRONNEMENT SA | EUR | 1.147.790,85 | 0,15 |
| 10.514 | VINCI SA | EUR | 1.098.495,79 | 0,14 |
| 15.768 | VIVENDI SE | EUR | 199.281,50 | 0,03 |
| 631 | WORLDLINE SA/FRANCE | EUR | 48.272,94 | 0,01 |
| | | | **22.758.229,32** | **2,99** |
| | **Deutschland** | | | |
| 2.784 | ADIDAS AG | EUR | 876.967,25 | 0,12 |
| 7.259 | ALLIANZ SE - REG | EUR | 1.639.153,44 | 0,22 |
| 9.875 | BASF SE | EUR | 753.628,96 | 0,10 |
| 2.055 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 157.188,39 | 0,02 |
| 3.358 | BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | EUR | 322.081,56 | 0,04 |
| 674 | BEIERSDORF AG | EUR | 73.004,62 | 0,01 |
| 522 | BRENNTAG SE | EUR | 48.748,63 | 0,01 |
| 11.678 | COMMERZBANK AG | EUR | 77.889,42 | 0,01 |
| 4.346 | CONTINENTAL AG | EUR | 477.437,95 | 0,06 |
| 12.216 | DAIMLER AG - REG | EUR | 1.086.181,27 | 0,14 |
| 2.797 | DELIVERY HERO SE | EUR | 358.032,85 | 0,05 |
| 2.138 | DEUTSCHE BOERSE AG | EUR | 348.135,83 | 0,05 |
| 18.126 | DEUTSCHE POST AG - REG | EUR | 1.144.468,30 | 0,15 |
| 61.254 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 1.234.947,64 | 0,16 |
| 8.397 | EVONIK INDUSTRIES AG | EUR | 265.383,54 | 0,03 |
| 2.148 | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | EUR | 151.506,38 | 0,02 |
| 5.676 | FRESENIUS SE & CO KGAA | EUR | 273.225,54 | 0,04 |
| 584 | GEA GROUP AG | EUR | 26.795,57 | 0,00 |
| 6.623 | HEIDELBERGCEMENT AG | EUR | 497.233,51 | 0,07 |
| 2.934 | HELLOFRESH SE | EUR | 271.892,73 | 0,04 |
| 4.689 | HENKEL AG & CO KGAA | EUR | 405.128,29 | 0,05 |
| 913 | HENKEL AG & CO KGAA - REG | EUR | 84.840,17 | 0,01 |
| 1.203 | KION GROUP AG | EUR | 112.736,37 | 0,01 |
| 262 | KNORR-BREMSE AG | EUR | 28.129,66 | 0,00 |
| 3.144 | MERCK KGAA | EUR | 683.747,57 | 0,09 |
| 1.779 | MUENCHENER RUECKVERSICHERUNGSGESELLSCHAFT AG IN MUENCHEN - REG | EUR | 488.433,79 | 0,06 |
| 268 | PUMA AG | EUR | 29.947,92 | 0,00 |
| 43 | RATIONAL AG | EUR | 40.595,47 | 0,01 |
| 13.415 | SAP SE | EUR | 1.817.170,06 | 0,24 |
| 493 | SARTORIUS AG | EUR | 314.135,01 | 0,04 |
| 4.630 | SCOUT24 AG | EUR | 321.741,67 | 0,04 |
| 14.222 | SIEMENS AG - REG | EUR | 2.339.208,69 | 0,31 |
| 7.034 | SIEMENS ENERGY AG | EUR | 189.372,22 | 0,02 |
| 5.418 | SIEMENS HEALTHINEERS AG | EUR | 352.764,95 | 0,05 |
| 2.417 | SYMRISE AG - A | EUR | 318.354,35 | 0,04 |
| 1.210 | TEAMVIEWER AG | EUR | 35.605,15 | 0,00 |
| 1.785 | UNITED INTERNET AG - REG | EUR | 69.550,56 | 0,01 |
| 869 | VITESCO TECHNOLOGIES GROUP AG | EUR | 51.363,50 | 0,01 |
| 6.013 | VONOVIA SE | EUR | 361.678,97 | 0,05 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.440 | ZALANDO SE | EUR | 132.376,19 | 0,02 |
| | | | **18.260.783,94** | **2,40** |
| | **Irland** | | | |
| 9.387 | ACCENTURE PLC - A | USD | 3.003.089,04 | 0,39 |
| 1.359 | ALLEGION PLC | USD | 179.632,62 | 0,02 |
| 3.735 | AON PLC - A | USD | 1.067.350,95 | 0,14 |
| 18.833 | CRH PLC | EUR | 885.283,04 | 0,13 |
| 1.143 | DCC PLC | GBP | 95.521,34 | 0,01 |
| 3.781 | HORIZON THERAPEUTICS PLC | USD | 414.170,74 | 0,05 |
| 1.554 | JAZZ PHARMACEUTICALS PLC | USD | 202.346,34 | 0,03 |
| 12.816 | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | USD | 872.513,28 | 0,11 |
| 890 | KINGSPAN GROUP PLC | EUR | 88.706,03 | 0,01 |
| 10.496 | LINDE PLC | USD | 3.079.316,48 | 0,40 |
| 23.658 | MEDTRONIC PLC | USD | 2.965.530,30 | 0,40 |
| 2.342 | PENTAIR PLC | USD | 170.099,46 | 0,02 |
| 5.802 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 305.145,46 | 0,04 |
| 1.576 | STERIS PLC | USD | 321.945,28 | 0,04 |
| 4.283 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | USD | 739.459,95 | 0,10 |
| 2.352 | WILLIS TOWERS WATSON PLC | USD | 546.745,92 | 0,07 |
| | | | **14.936.856,23** | **1,96** |
| | **Niederlande** | | | |
| 254 | ADYEN NV | EUR | 710.911,51 | 0,09 |
| 9.734 | AEGON NV | EUR | 50.393,21 | 0,01 |
| 4.028 | AKZO NOBEL NV | EUR | 440.589,48 | 0,06 |
| 772 | ARGENX SE | EUR | 232.177,09 | 0,03 |
| 5.703 | ASML HOLDING NV | EUR | 4.269.070,71 | 0,56 |
| 2.540 | CNH INDUSTRIAL NV | EUR | 43.272,87 | 0,01 |
| 1.083 | EXOR NV | EUR | 91.525,02 | 0,01 |
| 722 | FERRARI NV | EUR | 151.412,06 | 0,02 |
| 1.690 | HEINEKEN HOLDING NV | EUR | 147.386,57 | 0,02 |
| 6.632 | HEINEKEN NV | EUR | 693.291,30 | 0,09 |
| 39.583 | ING GROEP NV | EUR | 576.553,44 | 0,07 |
| 2.489 | JUST EAT TAKEAWAY.COM NV | EUR | 181.846,85 | 0,02 |
| 17.861 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 594.814,67 | 0,07 |
| 3.427 | KONINKLIJKE DSM NV | EUR | 686.114,90 | 0,09 |
| 9.691 | KONINKLIJKE PHILIPS NV | EUR | 430.611,27 | 0,06 |
| 1.843 | KONINKLIJKE VOPAK NV | EUR | 72.622,12 | 0,01 |
| 9.399 | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A | USD | 882.096,15 | 0,12 |
| 5.303 | NXP SEMICONDUCTORS NV | USD | 1.038.698,61 | 0,14 |
| 12.349 | PROSUS NV | EUR | 987.376,14 | 0,13 |
| 2.943 | QIAGEN NV | EUR | 152.769,27 | 0,02 |
| 38.591 | STELLANTIS NV | EUR | 738.947,09 | 0,09 |
| 15.793 | STMICROELECTRONICS NV | EUR | 691.224,02 | 0,09 |
| 15.768 | UNIVERSAL MUSIC GROUP NV | EUR | 422.410,98 | 0,06 |
| | | | **14.286.115,33** | **1,87** |
| | **Australien** | | | |
| 4.087 | AFTERPAY LTD | AUD | 357.100,02 | 0,05 |
| 2.653 | ASX LTD | AUD | 154.765,84 | 0,02 |
| 54.449 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD | AUD | 1.103.878,15 | 0,14 |
| 24.886 | BRAMBLES LTD | AUD | 193.029,49 | 0,03 |
| 1.177 | COCHLEAR LTD | AUD | 186.827,53 | 0,02 |
| 26.528 | COLES GROUP LTD | AUD | 324.601,65 | 0,04 |
| 7.978 | CSL LTD | AUD | 1.685.803,60 | 0,22 |
| 34.892 | DEXUS | AUD | 271.395,37 | 0,04 |
| 1.265 | DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES LTD | AUD | 146.187,47 | 0,02 |
| 54.471 | FORTESCUE METALS GROUP LTD | AUD | 586.880,63 | 0,08 |
| 44.278 | GOODMAN GROUP | AUD | 691.353,42 | 0,09 |
| 78.847 | GPT GROUP/THE | AUD | 287.902,87 | 0,04 |
| 36.623 | INSURANCE AUSTRALIA GROUP LTD | AUD | 129.769,26 | 0,02 |
| 6.050 | MACQUARIE GROUP LTD | AUD | 793.011,71 | 0,10 |
| 1.415 | MAGELLAN FINANCIAL GROUP LTD | AUD | 36.044,95 | 0,00 |
| 120.187 | MIRVAC GROUP | AUD | 258.810,30 | 0,03 |
| 65.528 | NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | AUD | 1.313.387,73 | 0,17 |
| 17.822 | QBE INSURANCE GROUP LTD | AUD | 149.660,71 | 0,02 |
| 1.306 | RAMSAY HEALTH CARE LTD | AUD | 65.483,22 | 0,01 |
| 4.540 | REA GROUP LTD | AUD | 519.392,78 | 0,07 |
| 22.060 | SEEK LTD | AUD | 494.422,17 | 0,06 |
| 1.415 | SONIC HEALTHCARE LTD | AUD | 41.435,89 | 0,01 |
| 75.609 | STOCKLAND | AUD | 243.951,97 | 0,03 |
| 24.077 | SUNCORP GROUP LTD | AUD | 217.793,47 | 0,03 |
| 46.992 | SYDNEY AIRPORT | AUD | 278.871,42 | 0,04 |
| 143.354 | TELSTRA CORP LTD | AUD | 405.746,85 | 0,05 |
| 57.571 | TRANSURBAN GROUP | AUD | 587.110,53 | 0,08 |
| 20.656 | TREASURY WINE ESTATES LTD | AUD | 184.616,63 | 0,02 |
| 32.091 | WESFARMERS LTD | AUD | 1.288.489,71 | 0,17 |
| 3.023 | WISETECH GLOBAL LTD | AUD | 116.804,81 | 0,02 |
| 30.299 | WOOLWORTHS GROUP LTD | AUD | 858.669,16 | 0,11 |
| | | | **13.973.199,31** | **1,83** |
| | **Spanien** | | | |
| 513 | AENA SME SA | EUR | 88.765,02 | 0,01 |
| 4.916 | AMADEUS IT GROUP SA | EUR | 324.068,00 | 0,04 |
| 77.696 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA | EUR | 514.791,71 | 0,07 |
| 275.998 | BANCO SANTANDER SA | EUR | 1.003.265,60 | 0,13 |
| 31.827 | EDP RENOVAVEIS SA | EUR | 790.096,00 | 0,10 |
| 34.108 | ENAGAS SA | EUR | 759.163,39 | 0,10 |
| 2.091 | GRIFOLS SA | EUR | 51.084,52 | 0,01 |
| 13.176 | INDUSTRIA DE DISENO TEXTIL SA | EUR | 485.901,74 | 0,06 |
| 51.261 | NATURGY ENERGY GROUP SA | EUR | 1.292.144,34 | 0,17 |
| 48.838 | RED ELECTRICA CORP SA | EUR | 979.759,83 | 0,13 |
| 104.839 | REPSOL SA | EUR | 1.372.742,67 | 0,18 |
| 1.920 | SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA | EUR | 48.998,55 | 0,01 |
| 63.185 | TELEFONICA SA | EUR | 296.354,75 | 0,04 |
| | | | **8.007.136,12** | **1,05** |
| | **Italien** | | | |
| 225.655 | ENEL SPA | EUR | 1.739.388,53 | 0,23 |
| 136.689 | ENI SPA | EUR | 1.829.067,83 | 0,24 |
| 8.489 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 24.138,33 | 0,00 |
| 483 | MONCLER SPA | EUR | 29.679,16 | 0,00 |
| 252.398 | SNAM SPA | EUR | 1.402.909,89 | 0,19 |
| 211.847 | TERNA - RETE ELETTRICA NAZIONALE | EUR | 1.506.511,19 | 0,20 |
| 2.769 | UNICREDIT SPA | EUR | 36.905,02 | 0,00 |
| | | | **6.568.599,95** | **0,86** |
| | **Schweden** | | | |
| 5.610 | ALFA LAVAL AB | SEK | 210.714,46 | 0,03 |
| 21.457 | ASSA ABLOY AB - B | SEK | 627.138,77 | 0,08 |
| 10.389 | ATLAS COPCO AB - A | SEK | 631.993,39 | 0,08 |
| 9.549 | ATLAS COPCO AB - B | SEK | 489.535,58 | 0,06 |
| 41.903 | BOLIDEN AB | SEK | 1.352.134,57 | 0,19 |
| 5.286 | EQT AB | SEK | 221.142,48 | 0,03 |
| 13.719 | H & M HENNES & MAURITZ AB | SEK | 279.694,45 | 0,04 |
| 4.923 | INDUSTRIVARDEN AB - A | SEK | 158.237,38 | 0,02 |
| 4.562 | INVESTMENT AB LATOUR - B | SEK | 142.045,12 | 0,02 |
| 24.500 | SANDVIK AB | SEK | 563.453,37 | 0,07 |
| 1.770 | SKANDINAVISKA ENSKILDA BANKEN AB - A | SEK | 25.067,35 | 0,00 |
| 2.348 | SKANSKA AB - B | SEK | 59.233,08 | 0,01 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.494 | SKF AB - B | SEK | 35.452,09 | 0,00 |
| 19.672 | SVENSKA CELLULOSA AB SCA -B | SEK | 306.709,20 | 0,04 |
| 3.232 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB - A | SEK | 36.322,62 | 0,00 |
| 46.269 | TELEFONAKTIEBOLAGET LM ERICSSON - B | SEK | 524.116,33 | 0,08 |
| 9.483 | TELE2 AB - B | SEK | 140.751,04 | 0,02 |
| 19.600 | TELIA CO AB | SEK | 80.933,41 | 0,01 |
| 24.769 | VOLVO AB - A SHS | SEK | 562.844,95 | 0,07 |
| | | | **6.447.519,64** | **0,85** |
| | **Hongkong** | | | |
| 209.800 | AIA GROUP LTD | HKD | 2.416.978,23 | 0,32 |
| 171.000 | BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | HKD | 514.671,44 | 0,07 |
| 20.900 | HANG SENG BANK LTD | HKD | 357.617,56 | 0,05 |
| 22.700 | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | HKD | 1.394.929,27 | 0,18 |
| 44.000 | SUN HUNG KAI PROPERTIES LTD | HKD | 548.880,39 | 0,07 |
| 71.400 | SWIRE PROPERTIES LTD | HKD | 178.502,42 | 0,02 |
| 28.000 | TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD | HKD | 556.206,31 | 0,07 |
| | | | **5.967.785,62** | **0,78** |
| | **Dänemark** | | | |
| 1.759 | AMBU AS - B | DKK | 52.048,15 | 0,01 |
| 48 | AP MOELLER - MAERSK AS - A | DKK | 123.813,53 | 0,02 |
| 175 | AP MOLLER - MAERSK AS - B | DKK | 474.178,24 | 0,06 |
| 3.031 | CHR HANSEN HOLDING AS | DKK | 247.729,37 | 0,03 |
| 1.658 | COLOPLAST AS - B | DKK | 260.092,11 | 0,03 |
| 3.976 | DSV A/S | DKK | 954.634,12 | 0,13 |
| 977 | GENMAB AS | DKK | 427.735,38 | 0,06 |
| 26.474 | NOVO NORDISK AS - B | DKK | 2.564.009,85 | 0,33 |
| 594 | PANDORA AS | DKK | 72.212,09 | 0,01 |
| 14.134 | VESTAS WIND SYSTEMS AS | DKK | 567.245,68 | 0,07 |
| | | | **5.743.698,52** | **0,75** |
| | **Singapur** | | | |
| 109.102 | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | SGD | 162.653,03 | 0,02 |
| 17.470 | CAPITALAND INVESTMENT LTD/SINGAPORE | SGD | 43.621,96 | 0,01 |
| 10.437 | DBS GROUP HOLDINGS LTD | SGD | 232.401,13 | 0,03 |
| 100.288 | OVERSEA-CHINESE BANKING CORP LTD | SGD | 846.993,69 | 0,11 |
| 109.800 | SINGAPORE AIRLINES LTD | SGD | 405.605,37 | 0,05 |
| 10.700 | SINGAPORE EXCHANGE LTD | SGD | 78.423,76 | 0,01 |
| 596.800 | SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS LTD | SGD | 1.078.195,07 | 0,15 |
| 33.300 | UNITED OVERSEAS BANK LTD | SGD | 632.176,19 | 0,08 |
| 5.600 | UOL GROUP LTD | SGD | 28.212,76 | 0,00 |
| | | | **3.508.282,96** | **0,46** |
| | **Österreich** | | | |
| 23.105 | OMV AG | EUR | 1.397.252,00 | 0,18 |
| 9.739 | VERBUND AG | EUR | 989.871,12 | 0,13 |
| 6.259 | VOESTALPINE AG | EUR | 232.413,93 | 0,03 |
| | | | **2.619.537,05** | **0,34** |
| | **Jersey** | | | |
| 6.023 | APTIV PLC | USD | 897.246,31 | 0,12 |
| 16.400 | EXPERIAN PLC | GBP | 687.491,28 | 0,09 |
| 3.903 | FERGUSON PLC | GBP | 543.890,73 | 0,07 |
| 23.978 | WPP PLC | GBP | 323.469,01 | 0,04 |
| | | | **2.452.097,33** | **0,32** |
| | **Bermuda** | | | |
| 6.830 | ARCH CAPITAL GROUP LTD | USD | 260.769,40 | 0,03 |
| 2.512 | ATHENE HOLDING LTD - A | USD | 173.001,44 | 0,02 |
| 5.766 | BUNGE LTD | USD | 468.891,12 | 0,06 |
| 509 | EVEREST RE GROUP LTD | USD | 127.647,02 | 0,02 |
| 9.217 | IHS MARKIT LTD | USD | 1.074.886,54 | 0,14 |
| 12.802 | INVESCO LTD | USD | 308.656,22 | 0,05 |
| 272 | RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | USD | 37.916,80 | 0,00 |
| | | | **2.451.768,54** | **0,32** |
| | **Norwegen** | | | |
| 19.151 | ADEVINTA ASA - B | NOK | 329.083,25 | 0,04 |
| 216.574 | NORSK HYDRO ASA | NOK | 1.625.561,01 | 0,22 |
| 28.211 | ORKLA ASA | NOK | 259.253,25 | 0,04 |
| 3.848 | SCHIBSTED ASA - B | NOK | 163.895,68 | 0,02 |
| 1.949 | TELENOR ASA | NOK | 32.888,01 | 0,00 |
| | | | **2.410.681,20** | **0,32** |
| | **Finnland** | | | |
| 10.142 | NESTE OYJ | EUR | 575.596,84 | 0,08 |
| 79.663 | NOKIA OYJ | EUR | 439.376,74 | 0,05 |
| 26.199 | NORDEA BANK ABP | SEK | 338.696,92 | 0,04 |
| 2.092 | SAMPO OYJ - A | EUR | 104.036,30 | 0,01 |
| 11.578 | STORA ENSO OYJ - R | EUR | 194.096,04 | 0,03 |
| 4.475 | WARTSILA OYJ | EUR | 53.704,15 | 0,01 |
| | | | **1.705.506,99** | **0,22** |
| | **Curacao** | | | |
| 52.814 | SCHLUMBERGER NV | USD | 1.565.406,96 | 0,21 |
| | | | **1.565.406,96** | **0,21** |
| | **Israel** | | | |
| 27.087 | BANK HAPOALIM BM | ILS | 239.288,16 | 0,04 |
| 2.318 | CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD | USD | 262.026,72 | 0,03 |
| 1.147 | CYBERARK SOFTWARE LTD | USD | 181.019,54 | 0,02 |
| 836 | NICE LTD | ILS | 233.219,16 | 0,03 |
| 2.389 | WIX.COM LTD | USD | 468.172,33 | 0,06 |
| | | | **1.383.725,91** | **0,18** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 13.819 | AUCKLAND INTERNATIONAL AIRPORT LTD | NZD | 74.326,40 | 0,01 |
| 43.334 | A2 MILK CO LTD/THE | NZD | 191.645,88 | 0,03 |
| 6.665 | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORP LTD | NZD | 146.693,16 | 0,02 |
| 187.526 | MERIDIAN ENERGY LTD | NZD | 635.869,67 | 0,08 |
| 7.511 | SPARK NEW ZEALAND LTD | NZD | 24.693,66 | 0,00 |
| 1.623 | XERO LTD | AUD | 162.474,86 | 0,02 |
| | | | **1.235.703,63** | **0,16** |
| | **Belgien** | | | |
| 1.100 | ETABLISSEMENTS FRANZ COLRUYT NV | EUR | 56.093,18 | 0,01 |
| 3.352 | KBC GROUP NV | EUR | 303.169,82 | 0,04 |
| 2.090 | UCB SA | EUR | 234.469,49 | 0,03 |
| 9.011 | UMICORE SA | EUR | 535.114,60 | 0,07 |
| | | | **1.128.847,09** | **0,15** |
| | **Panama** | | | |
| 29.326 | CARNIVAL CORP | USD | 733.443,26 | 0,10 |
| | | | **733.443,26** | **0,10** |
| | **Liberia** | | | |
| 7.043 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | USD | 626.474,85 | 0,08 |
| | | | **626.474,85** | **0,08** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 8.000 | CK ASSET HOLDINGS LTD | HKD | 46.209,64 | 0,01 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 15.600 | ESR CAYMAN LTD | HKD | 47.252,18 | 0,01 |
| 64.000 | WHARF REAL ESTATE INVESTMENT CO LTD | HKD | 330.332,35 | 0,04 |
| | | | **423.794,17** | **0,06** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 3.431 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | EUR | 252.975,86 | 0,03 |
| | | | **252.975,86** | **0,03** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 6.160 | AROUNDTOWN SA | EUR | 42.620,62 | 0,01 |
| 839 | EUROFINS SCIENTIFIC SE | EUR | 107.776,28 | 0,01 |
| | | | **150.396,90** | **0,02** |
| | **Portugal** | | | |
| 287 | JERONIMO MARTINS SGPS SA | EUR | 5.724,37 | 0,00 |
| | | | **5.724,37** | **0,00** |
| | | | **759.232.844,10** | **99,60** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **759.232.844,10** | **99,60** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | **Devisentermingeschäft** | | | |
| 2.105,87 | EUR | 2.498,66 | USD | 19/10/2021 | 2.498,66 | (57,34) |
| | | | | | **2.498,66** | **(57,34)** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD |
|---|---|---|---|
| | **Bezugsrechte** | | |
| 37.429 | VEOLIA ENVIRONNEMENT S.A. RIGHTS 01/10/2021 | EUR | 31.145,64 |
| 6.396 | TRANSURBAN GROUP RIGHTS 08/10/2021 | AUD | 4.836,72 |
| | | | **35.982,36** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | **35.925,02** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **759.232.844,10** | **99,60** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **35.925,02** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **1.567.166,98** | **0,21** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **1.414.964,72** | **0,19** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **762.250.900,82** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Equity Impact Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 477.295.733,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 358.534.001,52 |
| | 30.09.2019 | EUR | 280.943.826,41 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 15.499,29 |
| | 30.09.2020 | EUR | 12.181,36 |
| | 30.09.2019 | EUR | 10.908,12 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 13.592,48 |
| | 30.09.2020 | USD | 10.809,27 |
| | 30.09.2019 | USD | 8.998,70 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 264.716,32 |
| | 30.09.2020 | CZK | 207.244,48 |
| | 30.09.2019 | CZK | 185.649,17 |
| Capitalisation I Hedged (i) (NOK) | 30.09.2021 | NOK | 54.774,91 |
| | 30.09.2020 | NOK | - |
| | 30.09.2019 | NOK | - |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 64.726,78 |
| | 30.09.2020 | PLN | 50.575,24 |
| | 30.09.2019 | PLN | 45.020,08 |
| Capitalisation M (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 677,38 |
| | 30.09.2020 | EUR | 535,47 |
| | 30.09.2019 | EUR | 482,29 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 724,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | 568,41 |
| | 30.09.2019 | EUR | 507,92 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 724,71 |
| | 30.09.2020 | EUR | 568,35 |
| | 30.09.2019 | EUR | 507,86 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 666,88 |
| | 30.09.2020 | EUR | 529,33 |
| | 30.09.2019 | EUR | 478,71 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 257,88 |
| | 30.09.2020 | USD | 207,13 |
| | 30.09.2019 | USD | 174,14 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 316,71 |
| | 30.09.2020 | EUR | 249,98 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 358,84 |
| | 30.09.2020 | USD | 286,05 |
| | 30.09.2019 | USD | 238,71 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 619,95 |
| | 30.09.2020 | EUR | 494,56 |
| | 30.09.2019 | EUR | 449,51 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 157.914,27 |
| | 30.09.2020 | HUF | 127.365,27 |
| | 30.09.2019 | HUF | 106.768,98 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 545,45 |
| | 30.09.2020 | USD | 440,24 |
| | 30.09.2019 | USD | 371,97 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 15.851,84 |
| | 30.09.2020 | CZK | 12.581,62 |
| | 30.09.2019 | CZK | 11.446,09 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 548,91 |
| | 30.09.2019 | EUR | 493,90 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 667,48 |
| | 30.09.2020 | EUR | 529,81 |
| | 30.09.2019 | EUR | 479,33 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 81,92 |
| | 30.09.2020 | EUR | 64,54 |
| | 30.09.2019 | EUR | 58,12 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 10.040 |
| | 30.09.2020 | 9.795 |
| | 30.09.2019 | 9.125 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 184 |
| | 30.09.2020 | 3 |
| | 30.09.2019 | 4 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2.449 |
| | 30.09.2020 | 2.475 |
| | 30.09.2019 | 2.423 |
| Capitalisation I Hedged (i) (NOK) | 30.09.2021 | 338 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 4.190 |
| | 30.09.2020 | 1.395 |
| | 30.09.2019 | 807 |
| Capitalisation M (EUR) | 30.09.2021 | 7.433 |
| | 30.09.2020 | 9.944 |
| | 30.09.2019 | 11.286 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 42.621 |
| | 30.09.2020 | 45.888 |
| | 30.09.2019 | 52.614 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 82.893 |
| | 30.09.2020 | 107.686 |
| | 30.09.2019 | 21.638 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Equity Impact Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 61.858 |
| | 30.09.2020 | 75.321 |
| | 30.09.2019 | 89.258 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1.040 |
| | 30.09.2020 | 499 |
| | 30.09.2019 | 847 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 275 |
| | 30.09.2020 | 1.541 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 709 |
| | 30.09.2020 | 709 |
| | 30.09.2019 | 761 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 110.529 |
| | 30.09.2020 | 97.075 |
| | 30.09.2019 | 102.447 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 761 |
| | 30.09.2020 | 269 |
| | 30.09.2019 | 357 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 6.081 |
| | 30.09.2020 | 5.473 |
| | 30.09.2019 | 4.965 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 12.069 |
| | 30.09.2020 | 11.887 |
| | 30.09.2019 | 12.267 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 74 |
| | 30.09.2019 | 467 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 11.920 |
| | 30.09.2020 | 15.074 |
| | 30.09.2019 | 17.517 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 99.956 |
| | 30.09.2020 | 121.765 |
| | 30.09.2019 | 129.521 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation I Hedged (i) (NOK) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation M (EUR) | 30.09.2021 | 1,39% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (9,44%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Equity Impact Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **471.111.364,79** |
| Aktien | | 471.111.364,79 |
| **Bankguthaben** | | **5.089.009,41** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **11.358.909,33** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***487.559.283,53*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(9.134.386,90)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(1.129.163,54)** |
| Devisentermingeschäfte | | (1.129.163,54) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(10.263.550,44)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***477.295.733,09*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **2.388.040,35** |
| Dividenden | | 2.388.040,35 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(4.978.957,59)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (3.754.122,31) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.003.134,42) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (13.365,99) |
| Abonnementsteuer | 9 | (136.690,97) |
| Bankzinsen | | (71.643,90) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(2.590.917,24)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 56.710.896,08 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (13.356.638,82) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 1.285.416,52 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (97.818,96) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 1.382.644,60 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.201.060,80) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 61.965.134,90 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 101.253,84 |
| **Ergebnis** | | **104.198.910,12** |
| Zeichnungen | | 204.123.425,67 |
| Rücknahmen | | (189.560.604,22) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 358.534.001,52 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***477.295.733,09*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Equity Impact Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 22.000 | ADOBE INC | USD | 10.928.719,96 | 2,29 |
| 108.000 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 15.752.465,59 | 3,30 |
| 53.500 | ANSYS INC | USD | 15.716.014,50 | 3,29 |
| 78.000 | DANAHER CORP | USD | 20.489.512,06 | 4,29 |
| 184.000 | HOLOGIC INC | USD | 11.718.400,28 | 2,45 |
| 22.000 | ILLUMINA INC | USD | 7.699.572,89 | 1,61 |
| 48.000 | INTUIT INC | USD | 22.344.777,60 | 4,68 |
| 30.000 | MASTERCARD INC - A | USD | 8.999.870,57 | 1,89 |
| 59.000 | MICROSOFT CORP | USD | 14.352.025,54 | 3,01 |
| 24.000 | PAYCOM SOFTWARE INC | USD | 10.266.189,22 | 2,15 |
| 80.000 | SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | USD | 18.307.606,02 | 3,84 |
| 50.500 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 24.895.090,38 | 5,22 |
| 64.000 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 21.577.600,41 | 4,52 |
| 43.000 | VEEVA SYSTEMS INC - A | USD | 10.691.841,75 | 2,24 |
| 50.000 | XYLEM INC/NY | USD | 5.335.864,36 | 1,12 |
| | | | **219.075.551,13** | **45,90** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 1.700.000 | GB GROUP PLC | GBP | 17.108.145,82 | 3,58 |
| 512.000 | HALMA PLC | GBP | 16.929.025,10 | 3,55 |
| 9.250.000 | HELIOS TOWERS PLC | GBP | 19.478.621,65 | 4,08 |
| 705.000 | RWS HOLDINGS PLC | GBP | 5.138.638,98 | 1,08 |
| | | | **58.654.431,55** | **12,29** |
| | **Irland** | | | |
| 77.000 | ICON PLC - ADR | USD | 17.408.464,56 | 3,65 |
| 65.000 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | USD | 9.683.118,34 | 2,03 |
| | | | **27.091.582,90** | **5,68** |
| | **Indien** | | | |
| 1.000.000 | BANDHAN BANK LTD | INR | 3.277.013,67 | 0,69 |
| 735.000 | DABUR INDIA LTD | INR | 5.262.301,57 | 1,10 |
| 475.000 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD | INR | 15.111.639,96 | 3,17 |
| | | | **23.650.955,20** | **4,96** |
| | **Dänemark** | | | |
| 74.000 | CHR HANSEN HOLDING AS | DKK | 5.218.654,80 | 1,09 |
| 96.000 | NETCOMPANY GROUP AS | DKK | 9.560.056,59 | 2,00 |
| 210.000 | VESTAS WIND SYSTEMS AS | DKK | 7.272.114,28 | 1,53 |
| | | | **22.050.825,67** | **4,62** |
| | **Färöer-Inseln** | | | |
| 258.000 | BAKKAFROST P/F | NOK | 18.463.610,18 | 3,87 |
| | | | **18.463.610,18** | **3,87** |
| | **Hongkong** | | | |
| 1.630.000 | AIA GROUP LTD | HKD | 16.202.803,19 | 3,39 |
| | | | **16.202.803,19** | **3,39** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 340.000 | ARCO PLATFORM LTD - A | USD | 6.366.107,25 | 1,33 |
| 185.000 | PAGSEGURO DIGITAL LTD - A | USD | 8.255.921,31 | 1,73 |
| | | | **14.622.028,56** | **3,06** |
| | **Japan** | | | |
| 400.000 | SMS CO LTD | JPY | 12.598.696,86 | 2,64 |
| | | | **12.598.696,86** | **2,64** |
| | **Niederlande** | | | |
| 136.000 | ALFEN BEHEER BV | EUR | 12.376.000,00 | 2,59 |
| | | | **12.376.000,00** | **2,59** |
| | **Kanada** | | | |
| 160.000 | DESCARTES SYSTEMS GROUP INC | CAD | 11.235.405,36 | 2,35 |
| | | | **11.235.405,36** | **2,35** |
| | **Kenia** | | | |
| 27.000.000 | SAFARICOM PLC | KES | 8.960.364,27 | 1,88 |
| | | | **8.960.364,27** | **1,88** |
| | **Deutschland** | | | |
| 93.000 | HELLOFRESH SE | EUR | 7.436.280,00 | 1,56 |
| | | | **7.436.280,00** | **1,56** |
| | **Spanien** | | | |
| 261.000 | SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA | EUR | 5.747.220,00 | 1,20 |
| | | | **5.747.220,00** | **1,20** |
| | **Schweden** | | | |
| 62.000 | MIPS AB | SEK | 5.384.188,55 | 1,13 |
| | | | **5.384.188,55** | **1,13** |
| | **Schweiz** | | | |
| 18.500 | SIKA AG - REG | CHF | 5.078.776,49 | 1,06 |
| | | | **5.078.776,49** | **1,06** |
| | **Bangladesch** | | | |
| 650.000 | GRAMEENPHONE LTD | BDT | 2.482.644,88 | 0,52 |
| | | | **2.482.644,88** | **0,52** |
| | | | **471.111.364,79** | **98,70** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **471.111.364,79** | **98,70** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 851.347.468,70 | CZK | 33.497.532,19 | EUR | 19/10/2021 | 33.497.532,19 | 67.534,33 |
| 19.074.325,60 | NOK | 1.850.897,33 | EUR | 19/10/2021 | 1.850.897,33 | 33.747,42 |
| 1.638,55 | EUR | 41.801,93 | CZK | 01/10/2021 | 1.638,55 | (10,90) |
| 2.057,41 | EUR | 52.460,92 | CZK | 04/10/2021 | 2.057,41 | (12,63) |
| 25.938,10 | EUR | 659.212,97 | CZK | 19/10/2021 | 25.938,10 | (51,91) |
| 43.570,35 | EUR | 201.992,14 | PLN | 04/10/2021 | 43.570,35 | (317,32) |
| 29.124,13 | EUR | 299.943,05 | NOK | 19/10/2021 | 29.124,13 | (511,84) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Equity Impact Opportunities

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | Zu zahlen | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| 280.211.399,56 PLN | 62.092.891,87 EUR | 19/10/2021 | 62.092.891,87 | (1.229.540,69) |
| | | | **97.543.649,93** | **(1.129.163,54)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(1.129.163,54)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **471.111.364,79** | **98,70** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(1.129.163,54)** | **(0,24)** |
| **Bankguthaben** | **5.089.009,41** | **1,07** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **2.224.522,43** | **0,47** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **477.295.733,09** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 551.562.636,65 |
| | 30.09.2020 | EUR | 349.857.303,39 |
| | 30.09.2019 | EUR | 451.198.715,90 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 660,10 |
| | 30.09.2020 | EUR | 504,37 |
| | 30.09.2019 | EUR | 556,58 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 765,53 |
| | 30.09.2020 | USD | 591,84 |
| | 30.09.2019 | USD | 607,19 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 213.075,35 |
| | 30.09.2020 | CZK | 162.482,18 |
| | 30.09.2019 | CZK | 179.536,92 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 74.419,45 |
| | 30.09.2020 | PLN | 56.600,99 |
| | 30.09.2019 | PLN | 61.996,43 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 558,13 |
| | 30.09.2020 | EUR | 430,70 |
| | 30.09.2019 | EUR | 480,00 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 637,88 |
| | 30.09.2020 | USD | 498,06 |
| | 30.09.2019 | USD | 516,06 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 325,00 |
| | 30.09.2020 | EUR | 248,92 |
| | 30.09.2019 | EUR | 275,34 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 302,04 |
| | 30.09.2020 | USD | 234,07 |
| | 30.09.2019 | USD | 240,72 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 506,32 |
| | 30.09.2020 | EUR | 392,67 |
| | 30.09.2019 | EUR | 439,84 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 141.203,21 |
| | 30.09.2020 | HUF | 110.716,93 |
| | 30.09.2019 | HUF | 114.381,52 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 577,54 |
| | 30.09.2020 | USD | 453,17 |
| | 30.09.2019 | USD | 471,85 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 12.983,93 |
| | 30.09.2020 | CZK | 10.039,03 |
| | 30.09.2019 | CZK | 11.251,69 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 356,69 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.293,12 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.020,83 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.169,32 |
| Distribution P (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 145,75 |
| | 30.09.2020 | USD | 116,29 |
| | 30.09.2019 | USD | 123,23 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 300,76 |
| | 30.09.2020 | EUR | 235,62 |
| | 30.09.2019 | EUR | 267,85 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 287,29 |
| | 30.09.2020 | USD | 230,99 |
| | 30.09.2019 | USD | 247,39 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 298,18 |
| | 30.09.2020 | AUD | 240,36 |
| | 30.09.2019 | AUD | 270,43 |
| Distribution X (Q) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 369,45 |
| | 30.09.2020 | EUR | 292,75 |
| | 30.09.2019 | EUR | 335,66 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 257,78 |
| | 30.09.2020 | USD | 209,72 |
| | 30.09.2019 | USD | 227,21 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 269,71 |
| | 30.09.2020 | AUD | 220,12 |
| | 30.09.2019 | AUD | 250,97 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 289.718 |
| | 30.09.2020 | 178.778 |
| | 30.09.2019 | 217.517 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 52 |
| | 30.09.2020 | 52 |
| | 30.09.2019 | 4.864 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 5.800 |
| | 30.09.2020 | 5.759 |
| | 30.09.2019 | 5.402 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 6.114 |
| | 30.09.2020 | 5.955 |
| | 30.09.2019 | 6.947 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 105.490 |
| | 30.09.2020 | 121.999 |
| | 30.09.2019 | 142.818 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 66.620 |
| | 30.09.2020 | 57.879 |
| | 30.09.2019 | 51.618 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1.898 |
| | 30.09.2020 | 3.628 |
| | 30.09.2019 | 4.377 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 33 |
| | 30.09.2020 | 33 |
| | 30.09.2019 | 599 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 46.730 |
| | 30.09.2020 | 47.948 |
| | 30.09.2019 | 56.661 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 1.230 |
| | 30.09.2020 | 1.256 |
| | 30.09.2019 | 1.585 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 7.327 |
| | 30.09.2020 | 5.465 |
| | 30.09.2019 | 5.384 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 83.791 |
| | 30.09.2020 | 68.994 |
| | 30.09.2019 | 65.443 |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 15.000 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 12.326 |
| | 30.09.2020 | 16.328 |
| | 30.09.2019 | 19.571 |
| Distribution P (Q) (USD) | 30.09.2021 | 1.578 |
| | 30.09.2020 | 9.978 |
| | 30.09.2019 | 10.108 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 990 |
| | 30.09.2020 | 1.604 |
| | 30.09.2019 | 2.338 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 18.895 |
| | 30.09.2020 | 18.899 |
| | 30.09.2019 | 21.286 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | 15.882 |
| | 30.09.2020 | 16.690 |
| | 30.09.2019 | 17.082 |
| Distribution X (Q) (EUR) | 30.09.2021 | 751 |
| | 30.09.2020 | 1.132 |
| | 30.09.2019 | 1.431 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 89.868 |
| | 30.09.2020 | 4.461 |
| | 30.09.2019 | 8.724 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | 8.465 |
| | 30.09.2020 | 3.769 |
| | 30.09.2019 | 4.459 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 25,05 |
| Distribution P (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 1,05 |
| Distribution P (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 0,70 |
| Distribution P (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution P (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 0,80 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 5,75 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 08.04.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 06.10.2020 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 08.04.2021 | AUD | 0,60 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 06.10.2020 | AUD | 0,60 |
| Distribution X (Q) (EUR) | 11.08.2021 | EUR | 2,60 |
| Distribution X (Q) (EUR) | 12.05.2021 | EUR | 1,80 |
| Distribution X (Q) (EUR) | 11.02.2021 | EUR | 1,25 |
| Distribution X (Q) (EUR) | 11.11.2020 | EUR | 1,80 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 08.04.2021 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) (USD) | 06.10.2020 | USD | 0,53 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 08.04.2021 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,58 |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 06.10.2020 | AUD | 0,58 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P (Q) (USD) | 30.09.2021 | 1,78% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution X (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution X (Q) (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 3,30% |
| Distribution Y (M) Hedged (ii) (AUD) | 30.09.2021 | 3,32% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 43,81% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **541.521.549,98** |
| Aktien | | 541.521.549,98 |
| **Bankguthaben** | | **9.796.618,33** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **12.135.045,83** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***563.453.214,14*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(10.989.904,90)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(900.672,59)** |
| Devisentermingeschäfte | | (900.672,59) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(11.890.577,49)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***551.562.636,65*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **10.468.256,54** |
| Dividenden | | 10.347.312,95 |
| Sonstige Erträge | 10 | 120.943,59 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(6.222.982,36)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (4.856.759,93) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.134.221,07) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (35.703,41) |
| Abonnementsteuer | 9 | (126.456,30) |
| Bankzinsen | | (69.841,65) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **4.245.274,18** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 45.152.045,79 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (19.482.818,24) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 4.466.867,18 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (2.050.852,87) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 1.556.266,44 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.416.093,29) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 82.039.180,15 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 3.467.643,27 |
| **Ergebnis** | | **117.977.512,61** |
| Zeichnungen | | 161.005.367,40 |
| Rücknahmen | | (76.430.744,89) |
| Ausschüttung | | (846.801,86) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 349.857.303,39 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***551.562.636,65*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

#### Vereinigte Staaten

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 31.037 | ADVANCE AUTO PARTS INC | USD | 5.594.131,70 | 1,01 |
| 145.454 | AFLAC INC | USD | 6.542.574,76 | 1,19 |
| 23.052 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 5.279.115,85 | 0,96 |
| 11.888 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 2.709.226,94 | 0,49 |
| 77.984 | APPLE INC | USD | 9.521.321,89 | 1,73 |
| 54.980 | ATMOS ENERGY CORP | USD | 4.184.163,25 | 0,76 |
| 267.350 | BAKER HUGHES CO - A | USD | 5.704.789,25 | 1,02 |
| 343.066 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE | USD | 15.345.391,47 | 2,77 |
| 33.988 | BECTON DICKINSON AND CO | USD | 7.209.051,43 | 1,31 |
| 7.227 | BLACKROCK INC - A | USD | 5.229.730,20 | 0,95 |
| 105.339 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 5.378.065,17 | 0,98 |
| 12.641 | CARDINAL HEALTH INC | USD | 539.474,40 | 0,10 |
| 65.934 | CERNER CORP | USD | 4.011.964,00 | 0,73 |
| 82.335 | CHEVRON CORP | USD | 7.207.287,42 | 1,31 |
| 261.858 | CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE | USD | 12.298.141,37 | 2,22 |
| 95.925 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 6.255.672,38 | 1,13 |
| 246.477 | CONAGRA BRANDS INC | USD | 7.203.223,60 | 1,31 |
| 130.566 | CONOCOPHILLIPS | USD | 7.634.891,77 | 1,38 |
| 95.674 | EDISON INTERNATIONAL | USD | 4.579.176,65 | 0,83 |
| 116.618 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 9.478.765,78 | 1,72 |
| 20.058 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 1.415.024,01 | 0,26 |
| 145.707 | INTEL CORP | USD | 6.698.536,57 | 1,21 |
| 85.174 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 11.869.020,23 | 2,15 |
| 81.871 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 11.563.453,12 | 2,10 |
| 40.813 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 5.332.682,68 | 0,97 |
| 13.384 | MARTIN MARIETTA MATERIALS INC | USD | 3.945.851,95 | 0,72 |
| 133.240 | MERCK & CO INC | USD | 8.635.106,26 | 1,57 |
| 87.182 | MICROSOFT CORP | USD | 21.207.428,66 | 3,84 |
| 47.642 | M&T BANK CORP | USD | 6.139.053,70 | 1,11 |
| 44.799 | NORTHERN TRUST CORP | USD | 4.167.375,81 | 0,76 |
| 91.250 | ORACLE CORP | USD | 6.860.185,94 | 1,24 |
| 22.559 | PINNACLE WEST CAPITAL CORP | USD | 1.408.489,79 | 0,26 |
| 26.975 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | USD | 3.253.897,92 | 0,59 |
| 24.296 | QUALCOMM INC | USD | 2.703.911,37 | 0,49 |
| 39.064 | QUEST DIAGNOSTICS INC | USD | 4.897.872,94 | 0,89 |
| 32.906 | REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC - A | USD | 3.158.998,71 | 0,57 |
| 107.299 | SONOCO PRODUCTS CO | USD | 5.516.091,65 | 1,00 |
| 15.197 | T ROWE PRICE GROUP INC | USD | 2.579.274,26 | 0,47 |
| 175.146 | TRUIST FINANCIAL CORP | USD | 8.863.465,12 | 1,61 |
| 37.200 | UNITED PARCEL SERVICE INC - B | USD | 5.845.049,40 | 1,06 |
| 87.091 | US BANCORP | USD | 4.466.706,10 | 0,81 |
| 11.943 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 556.573,99 | 0,10 |
| 41.522 | WALMART INC | USD | 4.993.603,14 | 0,91 |
| | | | **267.983.812,60** | **48,59** |

#### Frankreich

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 133.181 | BNP PARIBAS SA | EUR | 7.383.554,64 | 1,34 |
| 233.227 | COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | EUR | 13.583.140,48 | 2,46 |
| 136.072 | DANONE SA | EUR | 8.035.051,60 | 1,46 |
| 447.821 | ENGIE SA | EUR | 5.079.185,78 | 0,92 |
| 70.575 | SANOFI | EUR | 5.863.371,00 | 1,06 |
| 32.247 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 4.640.343,30 | 0,84 |
| 276.652 | TOTALENERGIES SE | EUR | 11.435.410,42 | 2,07 |
| 60.413 | VINCI SA | EUR | 5.446.231,95 | 0,99 |
| | | | **61.466.289,17** | **11,14** |

#### Japan

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 274.600 | ANRITSU CORP | JPY | 4.234.519,17 | 0,77 |
| 138.400 | BRIDGESTONE CORP | JPY | 5.662.091,85 | 1,03 |
| 143.900 | KYOWA EXEO CORP | JPY | 3.050.065,09 | 0,55 |
| 126.000 | MURATA MANUFACTURING CO LTD | JPY | 9.676.169,28 | 1,75 |
| 976.100 | NISSAN MOTOR CO LTD | JPY | 4.230.400,38 | 0,77 |
| 78.000 | SONY GROUP CORP | JPY | 7.490.518,98 | 1,36 |
| 178.100 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | JPY | 5.415.946,93 | 0,98 |
| 116.900 | TREND MICRO INC/JAPAN | JPY | 5.606.327,58 | 1,02 |
| | | | **45.366.039,26** | **8,23** |

#### Schweiz

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 62.427 | CHUBB LTD | USD | 9.344.523,89 | 1,69 |
| 73.505 | NOVARTIS AG - REG | CHF | 5.223.615,36 | 0,95 |
| 25.282 | ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN | CHF | 7.996.455,23 | 1,45 |
| 59.944 | TE CONNECTIVITY LTD | USD | 7.097.386,15 | 1,29 |
| 733.580 | UBS GROUP AG - REG | CHF | 10.177.994,61 | 1,84 |
| 7.734 | ZURICH INSURANCE GROUP AG | CHF | 2.744.139,86 | 0,50 |
| | | | **42.584.115,10** | **7,72** |

#### Deutschland

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 51.560 | CONTINENTAL AG | EUR | 4.887.372,40 | 0,89 |
| 272.604 | DEUTSCHE TELEKOM AG - REG | EUR | 4.742.219,18 | 0,85 |
| 145.815 | EVONIK INDUSTRIES AG | EUR | 3.976.375,05 | 0,72 |
| 26.813 | SAP SE | EUR | 3.133.903,44 | 0,57 |
| 43.990 | SIEMENS AG - REG | EUR | 6.243.060,80 | 1,13 |
| 10.312 | VITESCO TECHNOLOGIES GROUP AG | EUR | 525.912,00 | 0,10 |
| 41.239 | VOLKSWAGEN AG - PREF | EUR | 7.985.519,96 | 1,45 |
| | | | **31.494.362,83** | **5,71** |

#### Vereinigtes Königreich

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 28.727 | IMI PLC | GBP | 554.799,78 | 0,10 |
| 283.577 | PRUDENTIAL PLC | GBP | 4.800.339,03 | 0,87 |
| 264.624 | SSE PLC | GBP | 4.836.635,17 | 0,88 |
| 297.297 | UNILEVER PLC | EUR | 13.867.418,57 | 2,51 |
| 4.753.835 | VODAFONE GROUP PLC | GBP | 6.266.310,76 | 1,15 |
| | | | **30.325.503,31** | **5,51** |

#### Irland

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 14.895 | LINDE PLC | USD | 3.770.563,96 | 0,68 |
| 119.017 | MEDTRONIC PLC | USD | 12.872.670,05 | 2,33 |
| 102.590 | NVENT ELECTRIC PLC | USD | 2.861.844,51 | 0,52 |
| 61.464 | PENTAIR PLC | USD | 3.851.874,82 | 0,70 |
| | | | **23.356.953,34** | **4,23** |

#### Kanada

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 172.846 | NUTRIEN LTD | CAD | 9.678.188,57 | 1,75 |
| 120.518 | OPEN TEXT CORP | CAD | 5.074.473,80 | 0,92 |
| | | | **14.752.662,37** | **2,67** |

#### Niederlande

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 36.061 | AIRBUS SE | EUR | 4.150.621,10 | 0,75 |
| 252.349 | KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | EUR | 7.251.248,52 | 1,32 |
| | | | **11.401.869,62** | **2,07** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Dividend

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Finnland** | | | |
| 451.469 | NORDEA BANK ABP | SEK | 5.036.046,72 | 0,91 |
| | | | **5.036.046,72** | **0,91** |
| | **Singapur** | | | |
| 256.800 | UNITED OVERSEAS BANK LTD | SGD | 4.206.532,13 | 0,76 |
| | | | **4.206.532,13** | **0,76** |
| | **Italien** | | | |
| 1.445.838 | INTESA SANPAOLO SPA | EUR | 3.547.363,53 | 0,64 |
| | | | **3.547.363,53** | **0,64** |
| | | | **541.521.549,98** | **98,18** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **541.521.549,98** | **98,18** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | **Devisentermingeschäfte** | | | |
| 75.620.620,00 | USD | 64.304.972,43 | EUR | 31/12/2021 | 64.304.972,43 | 810.334,62 |
| 2.264.739.928,60 | CZK | 89.110.836,27 | EUR | 19/10/2021 | 89.110.836,27 | 178.377,76 |
| 17.286.348,00 | AUD | 10.674.670,55 | EUR | 31/12/2021 | 10.674.670,55 | 82.898,21 |
| 41.054.302,00 | HKD | 4.484.838,57 | EUR | 31/12/2021 | 4.484.838,57 | 57.284,01 |
| 4.438.363,00 | CAD | 2.962.898,70 | EUR | 31/12/2021 | 2.962.898,70 | 54.062,33 |
| 6.640.451,99 | EUR | 855.044.520,00 | JPY | 30/12/2021 | 6.640.451,99 | 35.047,73 |
| 8.431.624,00 | CHF | 7.782.403,94 | EUR | 31/12/2021 | 7.782.403,94 | 19.634,56 |
| 2.004.482,72 | AUD | 1.243.897,35 | EUR | 19/10/2021 | 1.243.897,35 | 5.166,53 |
| 227.452,63 | USD | 311.177,78 | AUD | 19/10/2021 | 193.660,39 | 2.293,75 |
| 10.030.921,00 | SEK | 986.393,93 | EUR | 30/12/2021 | 986.393,93 | 2.005,71 |
| 244.734,03 | CHF | 360.869,39 | AUD | 19/10/2021 | 225.535,89 | 1.519,67 |
| 778.222,39 | EUR | 1.247.132,66 | AUD | 19/10/2021 | 778.222,39 | 1.090,05 |
| 562.442,43 | AUD | 378.057,22 | CHF | 19/10/2021 | 348.354,46 | 757,62 |
| 316.071,04 | AUD | 168.872,85 | GBP | 19/10/2021 | 196.097,82 | 538,70 |
| 35.939,17 | SGD | 36.027,71 | AUD | 19/10/2021 | 22.556,91 | 384,27 |
| 31.495.654,00 | DKK | 4.234.831,63 | EUR | 30/12/2021 | 4.234.831,63 | 298,39 |
| 15.246.340,00 | JPY | 188.921,29 | AUD | 19/10/2021 | 117.584,11 | 159,58 |
| 10.820,50 | CAD | 11.761,36 | AUD | 19/10/2021 | 7.290,93 | 38,55 |
| 43.071,57 | HKD | 7.640,00 | AUD | 19/10/2021 | 4.716,78 | 12,13 |
| 80.612,71 | SEK | 12.762,44 | AUD | 19/10/2021 | 7.925,80 | (3,53) |
| 19.166,13 | DKK | 4.153,67 | AUD | 19/10/2021 | 2.577,51 | (10,86) |
| 2.646,19 | EUR | 67.508,17 | CZK | 01/10/2021 | 2.646,19 | (17,59) |
| 6.505,13 | EUR | 165.870,98 | CZK | 04/10/2021 | 6.505,13 | (39,91) |
| 14.178,24 | GBP | 26.535,06 | AUD | 19/10/2021 | 16.518,01 | (44,19) |
| 45.891,88 | EUR | 1.167.575,28 | CZK | 19/10/2021 | 45.891,88 | (140,73) |
| 58.286,59 | AUD | 271.404,71 | DKK | 19/10/2021 | 36.381,54 | (177,87) |
| 89.092,52 | AUD | 564.815,93 | SEK | 19/10/2021 | 55.267,28 | (179,61) |
| 58.308,73 | AUD | 57.666,49 | SGD | 19/10/2021 | 36.100,58 | (304,91) |
| 689.191,78 | AUD | 55.691.293,00 | JPY | 19/10/2021 | 427.113,55 | (1.139,54) |
| 64.593,22 | AUD | 373.928,33 | HKD | 19/10/2021 | 40.318,03 | (1.185,67) |
| 244.568,34 | AUD | 226.747,97 | CAD | 19/10/2021 | 151.715,09 | (1.989,17) |
| 5.626.403,00 | GBP | 6.538.603,59 | EUR | 31/12/2021 | 6.538.603,59 | (4.464,99) |
| 2.330.556,52 | EUR | 3.702.110,00 | SGD | 31/12/2021 | 2.330.556,52 | (17.097,80) |
| 18.486.584,60 | EUR | 20.003.224,00 | CHF | 31/12/2021 | 18.486.584,60 | (23.007,84) |
| 5.086.798,59 | AUD | 3.746.931,49 | USD | 19/10/2021 | 3.153.202,67 | (62.322,44) |
| 447.934.827,88 | PLN | 99.334.188,95 | EUR | 19/10/2021 | 99.334.188,95 | (2.040.450,11) |
| | | | | | **324.992.311,96** | **(900.672,59)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(900.672,59)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **541.521.549,98** | **98,18** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(900.672,59)** | **(0,16)** |
| **Bankguthaben** | **9.796.618,33** | **1,78** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **1.145.140,93** | **0,20** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **551.562.636,65** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 2.161.764.602,16 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.720.274.544,64 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.972.865.425,12 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 8.428,67 |
| | 30.09.2020 | USD | 7.611,36 |
| | 30.09.2019 | USD | 7.379,29 |
| Capitalisation I Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 629,89 |
| | 30.09.2020 | EUR | 571,90 |
| | 30.09.2019 | EUR | 574,94 |
| Capitalisation I Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 45.542,81 |
| | 30.09.2020 | PLN | 41.196,38 |
| | 30.09.2019 | PLN | 41.004,25 |
| Capitalisation N Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 605,85 |
| | 30.09.2020 | EUR | 549,74 |
| | 30.09.2019 | EUR | 552,65 |
| Capitalisation P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 583,21 |
| | 30.09.2020 | EUR | 531,91 |
| | 30.09.2019 | EUR | 537,50 |
| Capitalisation P Hedged (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | 309,08 |
| Capitalisation R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 280,02 |
| | 30.09.2020 | EUR | 254,28 |
| | 30.09.2019 | EUR | 255,83 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 111.774,88 |
| | 30.09.2020 | HUF | 101.806,09 |
| | 30.09.2019 | HUF | 98.820,99 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 432,38 |
| | 30.09.2020 | USD | 394,11 |
| | 30.09.2019 | USD | 385,60 |
| Capitalisation X Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 539,64 |
| | 30.09.2020 | EUR | 494,60 |
| | 30.09.2019 | EUR | 502,18 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | 303,08 |
| Distribution I Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 21.247,54 |
| | 30.09.2020 | PLN | 19.888,56 |
| | 30.09.2019 | PLN | - |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 20.944,56 |
| | 30.09.2020 | PLN | - |
| | 30.09.2019 | PLN | 20.809,48 |
| Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.479,21 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.253,90 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.482,44 |
| Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 220,32 |
| | 30.09.2020 | EUR | 209,29 |
| | 30.09.2019 | EUR | 220,54 |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 808,58 |
| | 30.09.2020 | EUR | 765,93 |
| | 30.09.2019 | EUR | 801,83 |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 809,48 |
| | 30.09.2020 | EUR | 766,43 |
| | 30.09.2019 | EUR | 803,66 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 69,18 |
| | 30.09.2020 | USD | 69,41 |
| | 30.09.2019 | USD | 74,86 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 173,06 |
| | 30.09.2020 | AUD | 173,00 |
| | 30.09.2019 | AUD | 193,23 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 690,57 |
| | 30.09.2020 | EUR | 693,59 |
| | 30.09.2019 | EUR | 771,67 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 30.09.2021 | USD | 182,38 |
| | 30.09.2020 | USD | 182,22 |
| | 30.09.2019 | USD | 199,41 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 3.431,63 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 3.583,89 |
| | 30.09.2019 | ZAR | - |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 151,44 |
| | 30.09.2020 | USD | 153,64 |
| | 30.09.2019 | USD | 167,93 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 153,68 |
| | 30.09.2020 | AUD | 155,62 |
| | 30.09.2019 | AUD | 175,78 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 30.09.2021 | USD | 168,58 |
| | 30.09.2020 | USD | 170,29 |
| | 30.09.2019 | USD | 188,97 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 3.391,62 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 3.576,17 |
| | 30.09.2019 | ZAR | - |
| Distribution Z Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.824,79 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.567,49 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.752,41 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution Zz Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.874,27 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.613,18 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.794,12 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 298 |
| | 30.09.2020 | 134 |
| | 30.09.2019 | 118 |
| Capitalisation I Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 21.003 |
| | 30.09.2020 | 17.945 |
| | 30.09.2019 | 18.898 |
| Capitalisation I Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | 11.868 |
| | 30.09.2020 | 7.441 |
| | 30.09.2019 | 8.560 |
| Capitalisation N Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 16.887 |
| | 30.09.2020 | 17.008 |
| | 30.09.2019 | 15.819 |
| Capitalisation P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 17.300 |
| | 30.09.2020 | 20.107 |
| | 30.09.2019 | 21.724 |
| Capitalisation P Hedged (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 82 |
| Capitalisation R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 959 |
| | 30.09.2020 | 979 |
| | 30.09.2019 | 1.072 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 8.310 |
| | 30.09.2020 | 4.652 |
| | 30.09.2019 | 4.395 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 28.173 |
| | 30.09.2020 | 21.952 |
| | 30.09.2019 | 13.820 |
| Capitalisation X Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 41.022 |
| | 30.09.2020 | 37.407 |
| | 30.09.2019 | 22.406 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 706 |
| Distribution I Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | 75 |
| | 30.09.2020 | 6.317 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | 14.169 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 7.862 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 19.434 |
| | 30.09.2020 | 57.603 |
| | 30.09.2019 | 65.971 |
| Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 1.461 |
| | 30.09.2020 | 1.484 |
| | 30.09.2019 | 1.583 |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 24.329 |
| | 30.09.2020 | 35.387 |
| | 30.09.2019 | 58.209 |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 2.031 |
| | 30.09.2020 | 2.518 |
| | 30.09.2019 | 3.548 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 9.179.004 |
| | 30.09.2020 | 8.554.021 |
| | 30.09.2019 | 9.904.745 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 30.09.2021 | 2.053.422 |
| | 30.09.2020 | 2.324.744 |
| | 30.09.2019 | 2.820.389 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 48.302 |
| | 30.09.2020 | 40.916 |
| | 30.09.2019 | 43.711 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 30.09.2021 | 258.067 |
| | 30.09.2020 | 114.025 |
| | 30.09.2019 | 108.941 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 30.09.2021 | 258.265 |
| | 30.09.2020 | 17.020 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 1.438.641 |
| | 30.09.2020 | 79.148 |
| | 30.09.2019 | 3.085 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 30.09.2021 | 200.941 |
| | 30.09.2020 | 25.512 |
| | 30.09.2019 | 12.873 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 30.09.2021 | 604.868 |
| | 30.09.2020 | 62.437 |
| | 30.09.2019 | 2.519 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 30.09.2021 | 272.548 |
| | 30.09.2020 | 11.339 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution Z Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 22.377 |
| | 30.09.2020 | 14.361 |
| | 30.09.2019 | 10.795 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution Zz Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 92.156 |
| | 30.09.2020 | 86.938 |
| | 30.09.2019 | 69.875 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I Hedged (iii) (PLN) | 14.12.2020 | PLN | 901,55 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 02.09.2021 | PLN | 62,49 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 03.08.2021 | PLN | 62,49 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 02.07.2021 | PLN | 62,49 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 02.06.2021 | PLN | 78,03 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 04.05.2021 | PLN | 78,03 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 07.04.2021 | PLN | 78,03 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 02.03.2021 | PLN | 82,56 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 02.02.2021 | PLN | 82,56 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 05.01.2021 | PLN | 82,56 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 02.12.2020 | PLN | 80,20 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 03.11.2020 | PLN | 80,20 |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 02.10.2020 | PLN | 80,20 |
| Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR) | 11.08.2021 | EUR | 48,15 |
| Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR) | 12.05.2021 | EUR | 51,80 |
| Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR) | 11.02.2021 | EUR | 52,80 |
| Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR) | 11.11.2020 | EUR | 49,25 |
| Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR) | 11.08.2021 | EUR | 2,40 |
| Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR) | 12.05.2021 | EUR | 2,60 |
| Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR) | 11.02.2021 | EUR | 2,65 |
| Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR) | 11.11.2020 | EUR | 2,45 |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 30,05 |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 33,15 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,61 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,61 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,61 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,55 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,57 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,57 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,57 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 1,34 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 1,34 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 1,34 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 1,34 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 1,34 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 1,34 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 1,34 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 1,34 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 1,34 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 1,45 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 1,45 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 1,45 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 02.09.2021 | EUR | 5,38 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 03.08.2021 | EUR | 5,38 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 02.07.2021 | EUR | 5,38 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 02.06.2021 | EUR | 5,38 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 04.05.2021 | EUR | 5,38 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 07.04.2021 | EUR | 5,38 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 02.03.2021 | EUR | 5,38 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 02.02.2021 | EUR | 5,38 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 05.01.2021 | EUR | 5,38 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 02.12.2020 | EUR | 5,50 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 03.11.2020 | EUR | 5,50 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 02.10.2020 | EUR | 5,50 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,58 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,58 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,58 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,42 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,42 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,42 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,42 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,42 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,42 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,49 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,49 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,49 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 53,50 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 53,50 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 53,50 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 51,60 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 51,60 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 51,60 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 51,60 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 51,60 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 51,60 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 58,00 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 58,00 |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 58,00 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,33 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,33 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,33 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,21 |
| Distribution Y (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,21 |
| Distribution Y (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,21 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,21 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,21 |
| Distribution Y (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,21 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,32 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,32 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,32 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 1,20 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 1,20 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 1,20 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 1,20 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 1,20 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 1,20 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 1,20 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 1,20 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 1,20 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 1,36 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 1,36 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 1,36 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 02.09.2021 | USD | 1,46 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 03.08.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 02.07.2021 | USD | 1,46 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 02.06.2021 | USD | 1,32 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 04.05.2021 | USD | 1,32 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 07.04.2021 | USD | 1,32 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 02.03.2021 | USD | 1,32 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 02.02.2021 | USD | 1,32 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 05.01.2021 | USD | 1,32 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 02.12.2020 | USD | 1,45 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 03.11.2020 | USD | 1,45 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 02.10.2020 | USD | 1,45 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 53,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 53,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 53,10 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 51,40 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 51,40 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 51,40 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 51,40 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 51,40 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 51,40 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 58,00 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 58,00 |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 58,00 |
| Distribution Z Hedged (iii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 235,25 |
| Distribution Zz Hedged (iii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 241,35 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,89% |
| Capitalisation I Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Capitalisation I Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Capitalisation N Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,33% |
| Capitalisation R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,93% |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 1,81% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,81% |
| Capitalisation X Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Distribution I Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Distribution I (M) Hedged (iii) (PLN) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Distribution I (Q) Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,91% |
| Distribution N (Q) Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,32% |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,93% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 1,81% |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (AUD) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (USD) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Distribution X (M) Hedged (iii) (ZAR) | 30.09.2021 | 1,83% |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,83% |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (AUD) | 30.09.2021 | 2,85% |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (USD) | 30.09.2021 | 2,83% |
| Distribution Y (M) Hedged (iii) (ZAR) | 30.09.2021 | 2,83% |
| Distribution Z Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,10% |
| Distribution Zz Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,02% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (4,57%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **2.084.602.895,41** |
| Aktien | | 4.168.315,55 |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 191.718.218,28 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 1.888.716.361,58 |
| **Bankguthaben** | | **69.061.823,01** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **130.238.879,60** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***2.283.903.598,02*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(99.087.636,24)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(23.051.359,62)** |
| Zinsswaps | | (1.334.803,70) |
| Devisentermingeschäfte | | (21.716.555,92) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(122.138.995,86)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***2.161.764.602,16*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **93.386.824,29** |
| Dividenden | | 7.507,64 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 91.784.994,77 |
| Zinsen auf Swaps | | 40.143,52 |
| Sonstige Erträge | 10 | 1.554.178,36 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(24.757.673,58)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (18.058.379,19) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (5.070.040,64) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (180.618,55) |
| Abonnementsteuer | 9 | (596.276,61) |
| Bankzinsen | | (372.378,92) |
| Zinsen auf Swaps | | (479.979,67) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **68.629.150,71** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 52.953.114,25 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (84.516.859,31) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 22.835.723,83 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (38.200.127,65) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 11.112.615,66 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (11.602.639,18) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 164.554.816,06 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 8.516.400,69 |
| **Ergebnis** | | **194.282.195,06** |
| Zeichnungen | | 1.295.566.691,58 |
| Rücknahmen | | (910.985.148,77) |
| Ausschüttung | | (137.373.680,35) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 1.720.274.544,64 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***2.161.764.602,16*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

**Frankreich**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 292.566 | VALLOUREC SA | EUR | 2.208.873,30 | 0,10 |
| | | | **2.208.873,30** | **0,10** |

**Kroatien**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 664.156 | FORTENOVA EQUITY | EUR | 1.129.065,20 | 0,06 |
| | | | **1.129.065,20** | **0,06** |

**Irland**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 5.192 | SMURFIT KAPPA GROUP PLC | EUR | 235.612,96 | 0,01 |
| | | | **235.612,96** | **0,01** |

**Vereinigte Staaten**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2 | AMPLIFY ENERGY CORP | USD | 9,18 | 0,00 |
| | | | **9,18** | **0,00** |
| | | | **3.573.560,64** | **0,17** |

### Anleihen und andere Schuldtitel

**Vereinigte Staaten**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 8.305.000 | ACRISURE LLC / ACRISURE FINANCE INC 7.000% 15/11/2025 | USD | 7.304.259,36 | 0,34 |
| 1.100.000 | AHERN RENTALS INC 7.375% 15/05/2023 | USD | 905.449,48 | 0,04 |
| 6.415.000 | ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 4.625% 15/01/2027 | USD | 5.807.881,63 | 0,27 |
| 5.500.000 | ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 4.875% 15/02/2030 | USD | 5.125.010,67 | 0,24 |
| 1.320.000 | ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 5.875% 15/02/2028 | USD | 1.212.595,00 | 0,06 |
| 600.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.000% 01/06/2029 | USD | 511.479,19 | 0,02 |
| 8.351.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026 | USD | 7.623.968,19 | 0,35 |
| 21.908.000 | AMERICAN AIRLINES INC 11.750% 15/07/2025 | USD | 23.384.282,57 | 1,09 |
| 10.225.000 | AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 5.000% 01/10/2029 | USD | 8.597.059,92 | 0,40 |
| 4.767.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 01/03/2027 | USD | 4.251.283,98 | 0,20 |
| 9.430.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 15/01/2028 | USD | 8.431.712,19 | 0,39 |
| 3.235.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 7.875% 15/05/2026 | USD | 3.055.290,37 | 0,14 |
| 2.465.000 | ANTERO RESOURCES CORP 7.625% 01/02/2029 | USD | 2.376.760,10 | 0,11 |
| 1.392.000 | ANTERO RESOURCES CORP 8.375% 15/07/2026 | USD | 1.360.441,71 | 0,06 |
| 7.125.000 | APEX TOOL GROUP LLC / BC MOUNTAIN FINANCE INC 9.000% 15/02/2023 | USD | 6.162.736,77 | 0,29 |
| 7.550.000 | ARCHES BUYER INC 4.250% 01/06/2028 | USD | 6.606.545,63 | 0,31 |
| 745.000 | ARCHES BUYER INC 6.125% 01/12/2028 | USD | 655.089,32 | 0,03 |
| 2.800.000 | ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.250% 01/04/2028 | USD | 2.495.582,08 | 0,12 |
| 5.118.000 | ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.875% 01/04/2027 | USD | 4.628.805,36 | 0,21 |
| 10.430.000 | ARROW BIDCO LLC 9.500% 15/03/2024 | USD | 9.230.634,87 | 0,43 |
| 4.288.000 | ASHLAND LLC 3.375% 01/09/2031 | USD | 3.741.959,39 | 0,17 |
| 9.012.000 | AUDACY CAPITAL CORP 6.750% 31/03/2029 | USD | 7.839.610,30 | 0,36 |
| 5.300.000 | BAUSCH HEALTH AMERICAS INC 8.500% 31/01/2027 | USD | 4.877.758,77 | 0,23 |
| 8.393.000 | BCPE ULYSSES INTERMEDIATE INC 7.750% 01/04/2027 | USD | 7.218.279,02 | 0,33 |
| 9.705.000 | BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026 | USD | 8.729.885,78 | 0,40 |
| 3.210.000 | BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 7.625% 15/12/2025 | USD | 2.994.155,77 | 0,14 |
| 1.973.000 | BROADSTREET PARTNERS INC 5.875% 15/04/2029 | USD | 1.696.257,96 | 0,08 |
| 9.391.000 | BUILDERS FIRSTSOURCE INC 4.250% 01/02/2032 | USD | 8.289.172,39 | 0,38 |
| 2.802.000 | CAESARS RESORT COLLECTION LLC / CRC FINCO INC 5.250% 15/10/2025 | USD | 2.451.867,89 | 0,11 |
| 5.000.000 | CALLON PETROLEUM CO 6.375% 01/07/2026 | USD | 4.124.595,06 | 0,19 |
| 7.159.000 | CALLON PETROLEUM CO 8.000% 01/08/2028 | USD | 6.099.423,83 | 0,28 |
| 9.907.000 | CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC 4.750% 01/02/2028 | USD | 8.837.741,62 | 0,41 |
| 8.687.000 | CARRIAGE SERVICES INC 4.250% 15/05/2029 | USD | 7.564.815,14 | 0,35 |
| 3.424.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.250% 15/01/2034 | USD | 2.935.567,99 | 0,14 |
| 675.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 01/05/2032 | USD | 599.833,65 | 0,03 |
| 3.795.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 15/08/2030 | USD | 3.374.705,89 | 0,16 |
| 6.065.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.750% 01/03/2030 | USD | 5.470.531,25 | 0,25 |
| 3.012.000 | CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028 | USD | 2.611.466,16 | 0,12 |
| 21.642.000 | CENTENE CORP 2.500% 01/03/2031 | USD | 18.404.912,34 | 0,86 |
| 7.315.000 | CENTENE CORP 3.375% 15/02/2030 | USD | 6.532.935,26 | 0,30 |
| 6.975.000 | CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC 6.875% 01/04/2027 | USD | 6.131.226,74 | 0,28 |
| 6.625.000 | CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026 | EUR | 6.757.500,00 | 0,31 |
| 3.290.000 | CHEMOURS CO/THE 4.625% 15/11/2029 | USD | 2.772.535,11 | 0,13 |
| 421.000 | CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 3.250% 31/01/2032 | USD | 364.630,98 | 0,02 |
| 10.295.000 | CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.500% 01/10/2029 | USD | 9.449.775,21 | 0,44 |
| 15.047.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 5.625% 15/03/2027 | USD | 13.604.859,14 | 0,63 |
| 768.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.000% 15/01/2029 | USD | 702.373,88 | 0,03 |
| 200.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.125% 01/04/2030 | USD | 167.525,18 | 0,01 |
| 4.383.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.625% 15/02/2025 | USD | 3.958.300,33 | 0,18 |
| 9.514.000 | CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 3.875% 01/07/2028 | USD | 8.210.417,00 | 0,38 |
| 1.395.000 | CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 4.875% 01/07/2029 | USD | 1.206.019,78 | 0,06 |
| 913.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 3.750% 15/01/2032 | USD | 789.239,16 | 0,04 |
| 7.685.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 4.750% 15/03/2028 | USD | 7.015.690,77 | 0,32 |
| 5.000.000 | CLEVELAND-CLIFFS INC 4.625% 01/03/2029 | USD | 4.404.518,18 | 0,20 |
| 6.750.000 | CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875% 01/03/2031 | USD | 6.013.930,54 | 0,28 |
| 3.680.000 | CNX MIDSTREAM PARTNERS LP / CNX MIDSTREAM FINANCE CORP 6.500% 15/03/2026 | USD | 3.335.230,95 | 0,15 |
| 5.145.000 | COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC 5.875% 01/07/2029 | USD | 4.487.059,38 | 0,21 |
| 6.379.000 | COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC 7.750% 15/02/2026 | USD | 5.816.882,87 | 0,27 |
| 5.975.000 | COMSTOCK RESOURCES INC 5.875% 15/01/2030 | USD | 5.362.463,85 | 0,25 |
| 3.786.000 | COMSTOCK RESOURCES INC 6.750% 01/03/2029 | USD | 3.530.318,43 | 0,16 |
| 1.992.000 | CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC 6.000% 15/10/2026 | USD | 1.767.400,20 | 0,08 |
| 1.992.000 | CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC 6.500% 15/10/2028 | USD | 1.783.016,88 | 0,08 |
| 4.066.000 | CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 5.000% 01/10/2028 | USD | 3.620.931,98 | 0,17 |
| 4.620.000 | CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 6.500% 01/10/2028 | USD | 4.345.677,16 | 0,20 |
| 5.012.000 | COOPER-STANDARD AUTOMOTIVE INC 13.000% 01/06/2024 | USD | 4.751.568,36 | 0,22 |
| 2.324.000 | COTY INC 3.875% 15/04/2026 | EUR | 2.379.392,66 | 0,11 |
| 13.250.000 | COTY INC 4.000% 15/04/2023 | EUR | 13.359.418,63 | 0,62 |
| 1.500.000 | COTY INC 4.750% 15/04/2026 | EUR | 1.515.774,38 | 0,07 |
| 2.645.000 | CSC HOLDINGS LLC 4.125% 01/12/2030 | USD | 2.237.041,13 | 0,10 |
| 7.395.000 | CSC HOLDINGS LLC 4.625% 01/12/2030 | USD | 6.048.563,80 | 0,28 |
| 3.000.000 | DARLING INGREDIENTS INC 5.250% 15/04/2027 | USD | 2.690.659,19 | 0,12 |
| 2.850.000 | DIEBOLD NIXDORF INC 8.500% 15/04/2024 | USD | 2.511.520,51 | 0,12 |
| 1.230.000 | ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.500% 30/01/2026 | USD | 1.106.012,67 | 0,05 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 13.111.000 | ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.750% 30/01/2028 | USD | 11.911.489,26 | 0,55 |
| 10.240.000 | ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.150% 01/06/2025 | USD | 9.113.706,82 | 0,42 |
| 588.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.500% 15/01/2029 | USD | 527.015,13 | 0,02 |
| 588.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.750% 15/01/2031 | USD | 527.655,49 | 0,02 |
| 8.616.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 5.500% 15/07/2028 | USD | 8.177.125,89 | 0,38 |
| 3.515.000 | FORD MOTOR CO 4.750% 15/01/2043 | USD | 3.192.183,88 | 0,15 |
| 4.370.000 | FORD MOTOR CO 7.450% 16/07/2031 | USD | 4.918.202,52 | 0,23 |
| 13.050.000 | FORD MOTOR CO 8.500% 21/04/2023 | USD | 12.377.274,90 | 0,57 |
| 740.000 | FORD MOTOR CO 9.625% 22/04/2030 | USD | 905.550,12 | 0,04 |
| 975.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.355% 07/02/2025 EMTN | EUR | 968.949,26 | 0,04 |
| 6.000.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.386% 17/02/2026 | EUR | 6.184.284,18 | 0,29 |
| 8.450.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.900% 16/02/2028 | USD | 7.241.754,63 | 0,33 |
| 5.000.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 3.625% 17/06/2031 | USD | 4.353.795,12 | 0,20 |
| 1.451.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.000% 13/11/2030 | USD | 1.301.945,31 | 0,06 |
| 2.190.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.125% 17/08/2027 | USD | 2.004.523,86 | 0,09 |
| 3.935.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.542% 01/08/2026 | USD | 3.657.142,59 | 0,17 |
| 4.150.000 | FXI HOLDINGS INC 12.250% 15/11/2026 | USD | 4.055.626,83 | 0,19 |
| 5.178.000 | FXI HOLDINGS INC 7.875% 01/11/2024 | USD | 4.562.081,69 | 0,21 |
| 1.227.000 | GAP INC/THE 3.625% 01/10/2029 | USD | 1.061.264,53 | 0,05 |
| 1.840.000 | GAP INC/THE 3.875% 01/10/2031 | USD | 1.587.791,79 | 0,07 |
| 6.870.000 | GATES GLOBAL LLC / GATES CORP 6.250% 15/01/2026 | USD | 6.137.730,73 | 0,28 |
| 16.225.000 | GOLDEN NUGGET INC 6.750% 15/10/2024 | USD | 14.017.390,20 | 0,65 |
| 3.790.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.375% 15/06/2026 | USD | 3.318.492,08 | 0,15 |
| 1.450.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.750% 15/09/2030 | USD | 1.269.042,75 | 0,06 |
| 1.360.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 6.000% 15/04/2025 | USD | 1.228.036,08 | 0,06 |
| 16.930.000 | HCA INC 3.500% 01/09/2030 | USD | 15.474.713,73 | 0,72 |
| 8.070.000 | HUB INTERNATIONAL LTD 7.000% 01/05/2026 | USD | 7.200.400,35 | 0,33 |
| 7.836.000 | HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.250% 01/08/2026 | USD | 7.617.723,09 | 0,35 |
| 3.260.000 | IHEARTCOMMUNICATIONS INC 5.250% 15/08/2027 | USD | 2.925.346,08 | 0,14 |
| 3.300.000 | IHEARTCOMMUNICATIONS INC 6.375% 01/05/2026 | USD | 2.997.978,80 | 0,14 |
| 4.560.000 | IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.375% 01/05/2027 | USD | 4.203.160,71 | 0,19 |
| 7.205.000 | IMOLA MERGER CORP 4.750% 15/05/2029 | USD | 6.434.991,93 | 0,30 |
| 5.647.000 | INGLES MARKETS INC 4.000% 15/06/2031 | USD | 4.942.720,80 | 0,23 |
| 5.985.000 | INNOPHOS HOLDINGS INC 9.375% 15/02/2028 | USD | 5.582.434,01 | 0,26 |
| 1.672.000 | IQVIA INC 2.250% 15/01/2028 | EUR | 1.682.135,60 | 0,08 |
| 7.583.000 | JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO-ISSUER CORP 5.000% 15/08/2028 | USD | 6.635.443,97 | 0,31 |
| 9.367.000 | KB HOME 4.000% 15/06/2031 | USD | 8.292.952,28 | 0,38 |
| 16.500.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 4.375% 01/06/2046 | USD | 16.244.331,94 | 0,75 |
| 6.900.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 5.000% 15/07/2035 | USD | 7.328.068,98 | 0,34 |
| 8.213.000 | KRATON POLYMERS LLC / KRATON POLYMERS CAPITAL CORP 4.250% 15/12/2025 | USD | 7.390.282,26 | 0,34 |
| 6.581.000 | KRATON POLYMERS LLC / KRATON POLYMERS CAPITAL CORP 5.250% 15/05/2026 | EUR | 6.772.992,32 | 0,31 |
| 6.990.000 | LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLP / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 4.250% 01/02/2027 | USD | 5.997.594,18 | 0,28 |
| 2.213.000 | LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLP / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 4.750% 15/06/2029 | USD | 1.898.956,33 | 0,09 |
| 10.691.000 | LAREDO PETROLEUM INC 7.750% 31/07/2029 | USD | 9.242.382,73 | 0,43 |
| 7.160.000 | LOGMEIN INC 5.500% 01/09/2027 | USD | 6.273.875,39 | 0,29 |
| 6.618.000 | LPL HOLDINGS INC 4.000% 15/03/2029 | USD | 5.868.006,18 | 0,27 |
| 2.005.000 | LUMEN TECHNOLOGIES INC 4.000% 15/02/2027 | USD | 1.768.190,79 | 0,08 |
| 4.750.000 | LUMEN TECHNOLOGIES INC 5.125% 15/12/2026 | USD | 4.249.734,53 | 0,20 |
| 2.752.000 | MAJORDRIVE HOLDINGS IV LLC 6.375% 01/06/2029 | USD | 2.295.789,00 | 0,11 |
| 8.025.000 | MATADOR RESOURCES CO 5.875% 15/09/2026 | USD | 7.144.440,94 | 0,33 |
| 8.003.000 | MATTEL INC 3.750% 01/04/2029 | USD | 7.199.284,52 | 0,33 |
| 1.223.000 | MATTEL INC 6.200% 01/10/2040 | USD | 1.356.791,54 | 0,06 |
| 4.829.000 | MAV ACQUISITION CORP 5.750% 01/08/2028 | USD | 4.090.561,34 | 0,19 |
| 4.963.000 | MAV ACQUISITION CORP 8.000% 01/08/2029 | USD | 4.088.595,37 | 0,19 |
| 5.661.000 | MEDNAX INC 6.250% 15/01/2027 | USD | 5.137.232,14 | 0,24 |
| 9.100.000 | MICHAELS COS INC/THE 7.875% 01/05/2029 | USD | 8.142.574,94 | 0,38 |
| 1.059.000 | MIDCAP FINANCIAL ISSUER TRUST 5.625% 15/01/2030 | USD | 905.660,46 | 0,04 |
| 3.601.000 | MIDCAP FINANCIAL ISSUER TRUST 6.500% 01/05/2028 | USD | 3.245.987,23 | 0,15 |
| 7.894.000 | MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 7.010.041,54 | 0,32 |
| 8.207.000 | MOHEGAN GAMING & ENTERTAINMENT 8.000% 01/02/2026 | USD | 7.392.543,11 | 0,34 |
| 6.450.000 | NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC 5.500% 15/08/2028 | USD | 5.731.243,94 | 0,27 |
| 4.134.000 | NESCO HOLDINGS II INC 5.500% 15/04/2029 | USD | 3.701.819,38 | 0,17 |
| 6.222.000 | NETFLIX INC 3.875% 15/11/2029 | EUR | 7.523.810,95 | 0,35 |
| 1.850.000 | NETFLIX INC 4.875% 15/04/2028 | USD | 1.837.354,07 | 0,08 |
| 2.765.000 | NEW ENTERPRISE STONE & LIME CO INC 5.250% 15/07/2028 | USD | 2.413.703,26 | 0,11 |
| 9.501.000 | NEXSTAR MEDIA INC 5.625% 15/07/2027 | USD | 8.682.951,56 | 0,40 |
| 9.491.000 | NFP CORP 6.875% 15/08/2028 | USD | 8.358.418,03 | 0,39 |
| 6.300.000 | NMI HOLDINGS INC 7.375% 01/06/2025 | USD | 6.203.167,27 | 0,29 |
| 14.000.000 | NOKIA OF AMERICA CORP 6.450% 15/03/2029 | USD | 13.639.587,49 | 0,63 |
| 6.844.000 | NORTHERN OIL AND GAS INC 8.125% 01/03/2028 | USD | 6.337.443,84 | 0,29 |
| 520.000 | NUSTAR LOGISTICS LP 4.750% 01/02/2022 | USD | 449.963,33 | 0,02 |
| 6.492.000 | NUSTAR LOGISTICS LP 6.000% 01/06/2026 | USD | 6.076.949,88 | 0,28 |
| 6.575.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.200% 15/08/2026 | USD | 5.790.904,97 | 0,27 |
| 3.000.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.400% 15/04/2026 | USD | 2.657.114,09 | 0,12 |
| 9.000.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.500% 15/08/2029 | USD | 7.896.919,40 | 0,37 |
| 5.900.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.400% 15/04/2046 | USD | 5.065.082,93 | 0,23 |
| 4.460.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.125% 01/01/2031 | USD | 4.611.306,58 | 0,21 |
| 2.570.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.000% 15/07/2025 | USD | 2.646.597,00 | 0,12 |
| 2.975.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.500% 15/07/2027 | USD | 3.215.296,85 | 0,15 |
| 2.975.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.875% 15/07/2030 | USD | 3.487.320,06 | 0,16 |
| 4.390.000 | OLIN CORP 5.625% 01/08/2029 | USD | 4.142.172,90 | 0,19 |
| 1.010.000 | OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 3.875% 01/10/2028 | EUR | 1.011.525,92 | 0,05 |
| 3.356.000 | OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 4.250% 01/10/2028 | USD | 2.862.555,85 | 0,13 |
| 1.367.000 | OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 5.375% 01/10/2029 | EUR | 1.352.513,79 | 0,06 |
| 1.367.000 | OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 6.250% 01/10/2029 | USD | 1.170.663,68 | 0,05 |
| 580.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 6.625% 15/01/2028 | USD | 574.104,58 | 0,03 |
| 1.780.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 6.875% 15/03/2025 | USD | 1.725.605,34 | 0,08 |
| 12.410.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 7.125% 15/03/2026 | USD | 12.383.786,46 | 0,57 |
| 1.085.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 8.875% 01/06/2025 | USD | 1.014.706,06 | 0,05 |
| 10.236.000 | PARK RIVER HOLDINGS INC 5.625% 01/02/2029 | USD | 8.549.831,52 | 0,40 |
| 8.600.000 | PITNEY BOWES INC 6.875% 15/03/2027 | USD | 7.833.566,10 | 0,36 |
| 5.500.000 | PRA GROUP INC 5.000% 01/10/2029 | USD | 4.757.579,21 | 0,22 |
| 5.540.000 | PRA GROUP INC 7.375% 01/09/2025 | USD | 5.105.198,65 | 0,24 |
| 1.200.000 | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 3.375% 31/08/2027 | USD | 994.228,15 | 0,05 |
| 6.375.000 | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 5.250% 15/04/2024 | USD | 5.866.134,68 | 0,27 |
| 323.000 | PRIME SECURITY SERVICES BORROWER LLC / PRIME FINANCE INC 5.750% 15/04/2026 | USD | 301.388,51 | 0,01 |
| 6.000.000 | PRIMO WATER HOLDINGS INC 3.875% 31/10/2028 | EUR | 6.220.203,30 | 0,29 |
| 3.277.000 | PRIMO WATER HOLDINGS INC 4.375% 30/04/2029 | USD | 2.813.872,00 | 0,13 |
| 2.447.000 | RADIAN GROUP INC 4.875% 15/03/2027 | USD | 2.303.414,19 | 0,11 |
| 2.890.000 | RADIAN GROUP INC 6.625% 15/03/2025 | USD | 2.787.882,02 | 0,13 |
| 9.000.000 | RAIN CII CARBON LLC / CII CARBON CORP 7.250% 01/04/2025 | USD | 7.969.785,97 | 0,37 |
| 4.427.000 | RANGE RESOURCES CORP 8.250% 15/01/2029 | USD | 4.297.267,34 | 0,20 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 4.081.000 | RANGE RESOURCES CORP 9.250% 01/02/2026 | USD | 3.839.592,66 | 0,18 |
| 7.870.000 | REAL HERO MERGER SUB 2 INC 6.250% 01/02/2029 | USD | 7.044.036,12 | 0,33 |
| 3.419.000 | REALOGY GROUP LLC / REALOGY CO-ISSUER CORP 4.875% 01/06/2023 | USD | 3.061.670,20 | 0,14 |
| 2.202.000 | REALOGY GROUP LLC / REALOGY CO-ISSUER CORP 5.750% 15/01/2029 | USD | 1.970.657,99 | 0,09 |
| 960.000 | REALOGY GROUP LLC / REALOGY CO-ISSUER CORP 7.625% 15/06/2025 | USD | 883.878,93 | 0,04 |
| 3.000.000 | REALOGY GROUP LLC / REALOGY CO-ISSUER CORP 9.375% 01/04/2027 | USD | 2.853.225,85 | 0,13 |
| 1.468.000 | ROCKCLIFF ENERGY II LLC 5.500% 15/10/2029 | USD | 1.285.792,63 | 0,06 |
| 8.356.000 | ROCKET SOFTWARE INC 6.500% 15/02/2029 | USD | 7.131.111,48 | 0,33 |
| 5.350.000 | SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC 7.000% 15/05/2028 | USD | 4.984.721,74 | 0,23 |
| 2.650.000 | SCIENTIFIC GAMES INTERNATIONAL INC 8.625% 01/07/2025 | USD | 2.478.559,78 | 0,11 |
| 1.180.000 | SCRIPPS ESCROW II INC 3.875% 15/01/2029 | USD | 1.021.464,14 | 0,05 |
| 960.000 | SCRIPPS ESCROW II INC 5.375% 15/01/2031 | USD | 814.396,30 | 0,04 |
| 8.002.000 | SCRIPPS ESCROW INC 5.875% 15/07/2027 | USD | 7.076.913,90 | 0,33 |
| 1.895.000 | SENSATA TECHNOLOGIES INC 3.750% 15/02/2031 | USD | 1.645.842,18 | 0,08 |
| 1.700.000 | SENSATA TECHNOLOGIES INC 4.375% 15/02/2030 | USD | 1.577.626,14 | 0,07 |
| 7.075.000 | SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.000% 15/05/2031 | USD | 6.314.574,88 | 0,29 |
| 8.966.000 | SIGNAL PARENT INC 6.125% 01/04/2029 | USD | 7.426.666,41 | 0,34 |
| 7.900.000 | SINCLAIR TELEVISION GROUP INC 5.125% 15/02/2027 | USD | 6.786.441,78 | 0,31 |
| 1.056.000 | SIRIUS XM RADIO INC 3.125% 01/09/2026 | USD | 923.550,83 | 0,04 |
| 5.817.000 | SIRIUS XM RADIO INC 3.875% 01/09/2031 | USD | 4.904.317,89 | 0,23 |
| 5.628.000 | SIRIUS XM RADIO INC 4.000% 15/07/2028 | USD | 4.942.147,38 | 0,23 |
| 6.535.000 | SIRIUS XM RADIO INC 4.125% 01/07/2030 | USD | 5.668.054,53 | 0,26 |
| 6.016.000 | SIZZLING PLATTER LLC / SIZZLING PLATTER FINANCE CORP 8.500% 28/11/2025 | USD | 5.358.898,53 | 0,25 |
| 10.910.000 | SPRINT CAPITAL CORP 6.875% 15/11/2028 | USD | 12.023.442,72 | 0,56 |
| 2.345.000 | SPRINT CAPITAL CORP 8.750% 15/03/2032 | USD | 3.024.433,63 | 0,14 |
| 9.234.000 | SRM ESCROW ISSUER LLC 6.000% 01/11/2028 | USD | 8.445.138,81 | 0,39 |
| 5.700.000 | STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 3.375% 15/01/2031 | USD | 4.680.389,93 | 0,22 |
| 2.027.000 | STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 4.750% 15/01/2028 | USD | 1.822.358,19 | 0,08 |
| 9.487.000 | STAPLES INC 10.750% 15/04/2027 | USD | 7.964.664,14 | 0,37 |
| 7.986.000 | STAPLES INC 7.500% 15/04/2026 | USD | 6.988.105,84 | 0,32 |
| 1.327.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 3.625% 15/07/2026 | USD | 1.153.259,30 | 0,05 |
| 8.380.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 5.500% 01/11/2023 | USD | 7.591.148,90 | 0,35 |
| 8.774.000 | STONEX GROUP INC 8.625% 15/06/2025 | USD | 8.147.625,13 | 0,38 |
| 589.000 | SUMMER BC BIDCO B LLC 5.500% 31/10/2026 | USD | 521.185,23 | 0,02 |
| 7.871.000 | SUNCOKE ENERGY INC 4.875% 30/06/2029 | USD | 6.764.607,02 | 0,31 |
| 8.720.000 | SWF ESCROW ISSUER CORP 6.500% 01/10/2029 | USD | 7.314.428,02 | 0,34 |
| 6.175.000 | TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 6.000% 01/03/2027 | USD | 5.572.987,19 | 0,26 |
| 3.814.000 | TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 6.000% 31/12/2030 | USD | 3.372.718,67 | 0,16 |
| 2.635.000 | TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 7.500% 01/10/2025 | USD | 2.459.534,01 | 0,11 |
| 4.463.000 | TAP ROCK RESOURCES LLC 7.000% 01/10/2026 | USD | 3.942.610,78 | 0,18 |
| 1.663.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.000% 15/01/2032 | USD | 1.482.592,02 | 0,07 |
| 3.275.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.875% 01/02/2031 | USD | 3.048.043,90 | 0,14 |
| 5.354.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.375% 01/02/2027 | USD | 4.782.739,95 | 0,22 |
| 4.000.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.500% 01/03/2030 | USD | 3.774.714,35 | 0,17 |
| 1.385.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 6.500% 15/07/2027 | USD | 1.288.401,08 | 0,06 |
| 7.359.000 | TENET HEALTHCARE CORP 4.250% 01/06/2029 | USD | 6.449.082,18 | 0,30 |
| 4.510.000 | TENET HEALTHCARE CORP 4.625% 15/07/2024 | USD | 3.955.115,82 | 0,18 |
| 1.650.000 | TENET HEALTHCARE CORP 6.250% 01/02/2027 | USD | 1.479.752,17 | 0,07 |
| 3.862.000 | T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029 | USD | 3.365.941,46 | 0,16 |
| 6.655.000 | T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031 | USD | 5.793.704,09 | 0,27 |
| 2.700.000 | T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031 | USD | 2.458.806,87 | 0,11 |
| 4.855.000 | T-MOBILE USA INC 4.750% 01/02/2028 | USD | 4.447.522,51 | 0,21 |
| 5.385.000 | T-MOBILE USA INC 5.375% 15/04/2027 | USD | 4.873.058,30 | 0,23 |
| 8.765.000 | TTM TECHNOLOGIES INC 4.000% 01/03/2029 | USD | 7.530.388,70 | 0,35 |
| 6.280.000 | UNITED NATURAL FOODS INC 6.750% 15/10/2028 | USD | 5.865.469,99 | 0,27 |
| 1.416.000 | UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.750% 15/01/2032 | USD | 1.236.109,99 | 0,06 |
| 12.503.000 | UNITI GROUP LP / UNITI GROUP FINANCE INC / CSL CAPITAL LLC 6.500% 15/02/2029 | USD | 11.098.229,72 | 0,51 |
| 11.226.000 | UNIVISION COMMUNICATIONS INC 4.500% 01/05/2029 | USD | 9.863.483,83 | 0,46 |
| 6.755.000 | VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO INC 4.125% 15/08/2030 | USD | 6.192.272,04 | 0,29 |
| 4.845.000 | VICI PROPERTIES LP / VICI NOTE CO INC 4.625% 01/12/2029 | USD | 4.525.115,29 | 0,21 |
| 8.336.000 | VICTORIA'S SECRET & CO 4.625% 15/07/2029 | USD | 7.310.669,77 | 0,34 |
| 7.979.000 | WHITE CAP PARENT LLC 8.250% 15/03/2026 | USD | 7.108.101,39 | 0,33 |
| 3.800.000 | WOLVERINE ESCROW LLC 13.125% 15/11/2027 | USD | 2.156.660,09 | 0,10 |
| 7.385.000 | WORLD ACCEPTANCE CORP 7.000% 01/11/2026 | USD | 6.289.354,98 | 0,29 |
| 1.072.000 | WR GRACE HOLDINGS LLC 5.625% 15/08/2029 | USD | 954.549,69 | 0,04 |
| 9.592.000 | W&T OFFSHORE INC 9.750% 01/11/2023 | USD | 7.860.340,30 | 0,36 |
| | | | **1.185.291.734,99** | **54,83** |
| | **Frankreich** | | | |
| 5.000.000 | ALTICE FRANCE SA 2.125% 15/02/2025 | EUR | 4.850.245,00 | 0,22 |
| 2.857.000 | ALTICE FRANCE SA 3.375% 15/01/2028 | EUR | 2.749.862,50 | 0,13 |
| 3.590.000 | ALTICE FRANCE SA 4.125% 15/01/2029 | EUR | 3.554.192,55 | 0,16 |
| 3.045.000 | ALTICE FRANCE SA/FRANCE 4.000% 15/07/2029 | EUR | 2.996.242,82 | 0,14 |
| 4.000.000 | ALTICE FRANCE SA/FRANCE 4.250% 15/10/2029 | EUR | 3.951.035,80 | 0,18 |
| 2.200.000 | BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 3.500% 01/03/2025 | EUR | 2.224.597,25 | 0,10 |
| 250.000 | BANIJAY ENTERTAINMENT SASU 5.375% 01/03/2025 | USD | 222.587,43 | 0,01 |
| 4.000.000 | BANIJAY GROUP SAS 6.500% 01/03/2026 | EUR | 4.171.922,32 | 0,19 |
| 5.000.000 | CASINO GUICHARD PERRACHO 5.250% 15/04/2027 | EUR | 5.031.585,90 | 0,23 |
| 3.900.000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA FRN PERP EMTN | EUR | 2.789.199,08 | 0,13 |
| 10.000.000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA 1.865% 13/06/2022 EMTN | EUR | 9.966.659,00 | 0,47 |
| 1.300.000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA 2.798% 05/08/2026 EMTN | EUR | 1.267.885,65 | 0,06 |
| 2.000.000 | CASINO GUICHARD PERRACHON SA 4.498% 07/03/2024 EMTN | EUR | 2.013.097,72 | 0,09 |
| 3.000.000 | CMA CGM SA 5.250% 15/01/2025 | EUR | 3.042.570,12 | 0,14 |
| 3.101.000 | CONSTELLIUM SE 3.125% 15/07/2029 | EUR | 3.116.467,91 | 0,14 |
| 6.000.000 | CONSTELLIUM SE 4.250% 15/02/2026 | EUR | 6.075.000,00 | 0,28 |
| 2.690.000 | FAURECIA SE 2.375% 15/06/2027 | EUR | 2.703.948,94 | 0,13 |
| 771.000 | FAURECIA SE 2.375% 15/06/2029 | EUR | 779.082,47 | 0,04 |
| 2.315.000 | FAURECIA SE 3.125% 15/06/2026 | EUR | 2.369.889,51 | 0,11 |
| 4.785.000 | FAURECIA SE 3.750% 15/06/2028 | EUR | 4.979.871,66 | 0,23 |
| 2.600.000 | KAPLA HOLDING SAS 3.375% 15/12/2026 | EUR | 2.613.000,00 | 0,12 |
| 5.000.000 | LA FINANCIERE ATALIAN SASU 4.000% 15/05/2024 | EUR | 4.913.245,75 | 0,23 |
| 5.000.000 | PAPREC HOLDING SA 3.500% 01/07/2028 | EUR | 5.062.500,00 | 0,23 |
| 9.000.000 | PICARD GROUPE SAS 3.875% 01/07/2026 | EUR | 9.144.150,30 | 0,42 |
| 6.193.000 | QUATRIM SASU 5.875% 15/01/2024 | EUR | 6.378.790,00 | 0,30 |
| 3.400.000 | RUBIS TERMINAL INFRA SAS 5.625% 15/05/2025 | EUR | 3.571.045,16 | 0,17 |
| 4.871.000 | TEREOS FINANCE GROUPE I SA 7.500% 30/10/2025 | EUR | 5.236.325,00 | 0,24 |
| 7.500.000 | VALLOUREC SA 8.500% 30/06/2026 | EUR | 7.689.808,80 | 0,36 |
| | | | **113.464.808,64** | **5,25** |
| | **Niederlande** | | | |
| 4.000.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP | EUR | 3.950.000,00 | 0,18 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 4.200.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS FINANCE BV FRN PERP | EUR | 4.314.464,28 | 0,20 |
| 3.100.000 | DARLING GLOBAL FINANCE BV 3.625% 15/05/2026 | EUR | 3.154.075,69 | 0,15 |
| 6.175.000 | DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV 9.000% 15/07/2025 | EUR | 6.702.685,74 | 0,31 |
| 4.662.000 | NOBEL BIDCO BV 3.125% 15/06/2028 | EUR | 4.632.862,50 | 0,21 |
| 6.850.000 | NOBIAN FINANCE BV 3.625% 15/07/2026 | EUR | 6.793.144,93 | 0,31 |
| 14.086.000 | SIGMA HOLDCO BV 5.750% 15/05/2026 | EUR | 13.439.428,37 | 0,62 |
| 400.000 | SIGMA HOLDCO BV 7.875% 15/05/2026 | USD | 341.537,12 | 0,02 |
| 506 | STICHTING AK RABOBANK CERTIFICATEN 19.436% PERP STEP-UP | EUR | 727,43 | 0,00 |
| 3.000.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 3.254.382,06 | 0,15 |
| 5.600.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 5.785.495,97 | 0,27 |
| 5.200.000 | TRIVIUM PACKAGING FINANCE BV 3.750% 15/08/2026 | EUR | 5.322.247,11 | 0,25 |
| 11.000.000 | VZ VENDOR FINANCING II BV 2.875% 15/01/2029 | EUR | 10.878.098,22 | 0,50 |
| 3.000.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2.000% 23/02/2026 | EUR | 3.026.250,00 | 0,14 |
| 4.500.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 2.500% 23/10/2027 | EUR | 4.599.271,98 | 0,21 |
| 2.500.000 | ZF EUROPE FINANCE BV 3.000% 23/10/2029 | EUR | 2.600.312,63 | 0,12 |
| 7.000.000 | ZIGGO BV 2.875% 15/01/2030 | EUR | 7.068.265,54 | 0,33 |
| 5.000.000 | ZIGGO BV 5.500% 15/01/2027 | USD | 4.457.824,28 | 0,21 |
| | | | **90.321.073,85** | **4,18** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 7.000.000 | BELLIS ACQUISITION CO PLC 3.250% 16/02/2026 | GBP | 8.001.446,64 | 0,37 |
| 1.231.000 | BELLIS FINCO PLC 4.000% 16/02/2027 | GBP | 1.400.311,58 | 0,06 |
| 9.350.000 | EC FINANCE PLC 2.375% 15/11/2022 | EUR | 9.380.534,95 | 0,43 |
| 4.708.000 | EC FINANCE PLC 3.000% 15/10/2026 | EUR | 4.743.310,00 | 0,22 |
| 3.000.000 | EG GLOBAL FINANCE PLC 4.375% 07/02/2025 | EUR | 2.981.250,00 | 0,14 |
| 2.650.000 | EG GLOBAL FINANCE PLC 6.250% 30/10/2025 | EUR | 2.709.625,00 | 0,13 |
| 1.600.000 | EG GLOBAL FINANCE PLC 6.750% 07/02/2025 | USD | 1.417.187,09 | 0,07 |
| 817.000 | EG GLOBAL FINANCE PLC 8.500% 30/10/2025 | USD | 735.730,71 | 0,03 |
| 3.127.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC 3.750% 15/07/2026 | EUR | 3.214.038,07 | 0,15 |
| 10.000.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 2.500% 15/01/2026 | EUR | 10.087.857,30 | 0,47 |
| 1.461.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 3.375% 15/01/2026 | USD | 1.273.819,97 | 0,06 |
| 11.100.000 | INTERNATIONAL GAME TECHNOLOGY PLC 5.250% 15/01/2029 | USD | 10.240.184,49 | 0,46 |
| 4.400.000 | JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 2.200% 15/01/2024 | EUR | 4.301.000,00 | 0,20 |
| 1.250.000 | JAGUAR LAND ROVER AUTOMOTIVE PLC 5.875% 15/11/2024 | EUR | 1.332.928,36 | 0,06 |
| 5.000.000 | MATALAN FINANCE PLC 6.750% 31/01/2023 | GBP | 5.476.213,17 | 0,25 |
| 6.700.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 6.500% 15/02/2023 | EUR | 6.816.946,02 | 0,32 |
| 2.854.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 8.000% 15/02/2023 | USD | 2.513.046,75 | 0,12 |
| 5.125.000 | NOMAD FOODS BONDCO PLC 2.500% 24/06/2028 | EUR | 5.201.875,00 | 0,24 |
| 8.000.000 | VMED O2 UK FINANCING I PLC 3.250% 31/01/2031 | EUR | 8.213.059,28 | 0,38 |
| | | | **90.040.364,38** | **4,16** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 3.400.000 | ADLER GROUP SA 1.875% 14/01/2026 | EUR | 2.873.000,00 | 0,13 |
| 3.400.000 | ADLER GROUP SA 2.250% 14/01/2029 | EUR | 2.771.000,00 | 0,13 |
| 6.400.000 | ADLER GROUP SA 2.250% 27/04/2027 | EUR | 5.344.000,00 | 0,25 |
| 1.850.000 | ALTICE FINANCING SA 2.250% 15/01/2025 | EUR | 1.780.625,00 | 0,08 |
| 3.800.000 | ALTICE FRANCE HOLDING SA 10.500% 15/05/2027 | USD | 3.579.194,24 | 0,17 |
| 300.000 | ALTICE FRANCE HOLDING SA 6.000% 15/02/2028 | USD | 246.965,37 | 0,01 |
| 13.500.000 | ALTICE FRANCE HOLDING SA 8.000% 15/05/2027 | EUR | 14.380.184,07 | 0,67 |
| 7.770.000 | ARD FINANCE SA 5.000% 30/06/2027 | EUR | 8.071.859,53 | 0,37 |
| 6.930.000 | CRYSTAL ALMOND SARL 4.250% 15/10/2024 | EUR | 7.085.925,00 | 0,33 |
| 17.944.000 | GALAPAGOS HOLDING SA 7.000% 15/06/2022 - DEFAULTED | EUR | 538.320,00 | 0,02 |
| 6.000.000 | KLEOPATRA FINCO SARL 4.250% 01/03/2026 | EUR | 5.880.252,72 | 0,27 |
| 2.500.000 | KLEOPATRA HOLDINGS 2 SCA 6.500% 01/09/2026 | EUR | 2.360.291,28 | 0,11 |
| 8.940.000 | LINCOLN FINANCING SARL 3.625% 01/04/2024 | EUR | 9.013.193,21 | 0,42 |
| 5.600.000 | MITSUBISHI UFJ INVESTOR SERVICES & BANKING LUXEMBOURG SA 15/12/2050 FRN EMTN | EUR | 2.843.185,52 | 0,13 |
| 2.600.000 | MOTION FINCO SARL 7.000% 15/05/2025 | EUR | 2.734.462,67 | 0,13 |
| 3.424.000 | SUMMER BC HOLDCO A SARL 9.250% 31/10/2027 | EUR | 3.723.600,00 | 0,17 |
| 8.000.000 | SUMMER BC HOLDCO B SARL 5.750% 31/10/2026 | EUR | 8.380.000,00 | 0,39 |
| 5.300.000 | VIVION INVESTMENTS SARL 3.000% 08/08/2024 | EUR | 5.167.500,00 | 0,24 |
| 2.000.000 | VIVION INVESTMENTS SARL 3.500% 01/11/2025 | EUR | 1.980.842,48 | 0,09 |
| | | | **88.754.401,09** | **4,11** |
| | **Deutschland** | | | |
| 6.500.000 | ADLER PELZER HOLDING GMBH 4.125% 01/04/2024 | EUR | 6.167.608,40 | 0,29 |
| 2.450.000 | APCOA PARKING HOLDINGS GMBH 4.625% 15/01/2027 | EUR | 2.478.639,91 | 0,11 |
| 4.000.000 | COMMERZBANK AG FRN PERP | EUR | 4.030.331,16 | 0,19 |
| 4.000.000 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 12/08/2075 FRN | EUR | 3.927.028,72 | 0,18 |
| 4.000.000 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.000% 29/05/2026 EMTN | EUR | 4.120.000,00 | 0,19 |
| 5.700.000 | DEUTSCHE LUFTHANSA AG 3.750% 11/02/2028 EMTN | EUR | 5.990.180,39 | 0,28 |
| 4.040.000 | HT TROPLAST GMBH 9.250% 15/07/2025 | EUR | 4.433.689,27 | 0,21 |
| 8.100.000 | IHO VERWALTUNGS GMBH 3.625% 15/05/2025 | EUR | 8.240.275,07 | 0,37 |
| 2.800.000 | SCHAEFFLER AG 2.750% 12/10/2025 EMTN | EUR | 2.981.536,60 | 0,14 |
| 2.400.000 | SCHAEFFLER AG 3.375% 12/10/2028 EMTN | EUR | 2.688.000,00 | 0,12 |
| 3.850.000 | SGL CARBON SE 4.625% 30/09/2024 | EUR | 3.920.172,49 | 0,18 |
| 7.500.000 | TUI CRUISES GMBH 6.500% 15/05/2026 | EUR | 7.725.000,00 | 0,36 |
| 1.000.000 | ZF FINANCE GMBH 2.000% 06/05/2027 EMTN | EUR | 1.005.076,66 | 0,05 |
| 4.000.000 | ZF FINANCE GMBH 2.750% 25/05/2027 EMTN | EUR | 4.144.365,72 | 0,19 |
| | | | **61.851.904,39** | **2,86** |
| | **Italien** | | | |
| 2.365.000 | ATLANTIA SPA 1.625% 03/02/2025 EMTN | EUR | 2.424.125,00 | 0,11 |
| 3.190.000 | ATLANTIA SPA 1.875% 12/02/2028 | EUR | 3.317.600,00 | 0,15 |
| 2.150.000 | ATLANTIA SPA 1.875% 13/07/2027 EMTN | EUR | 2.238.839,16 | 0,10 |
| 3.125.000 | AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 1.750% 26/06/2026 EMTN | EUR | 3.229.968,38 | 0,15 |
| 2.750.000 | AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 1.875% 26/09/2029 EMTN | EUR | 2.869.792,39 | 0,13 |
| 8.000.000 | AUTOSTRADE PER L'ITALIA SPA 2.000% 15/01/2030 | EUR | 8.390.178,88 | 0,40 |
| 4.335.000 | BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 1.875% 09/01/2026 | EUR | 4.356.675,00 | 0,20 |
| 4.700.000 | BANCA MONTE DEI PASCHI DI SIENA SPA 2.625% 28/04/2025 EMTN | EUR | 4.806.453,68 | 0,22 |
| 3.500.000 | BANCO BPM SPA FRN PERP | EUR | 3.846.911,57 | 0,18 |
| 4.000.000 | BANCO BPM SPA FRN PERP | EUR | 4.218.643,96 | 0,20 |
| 7.000.000 | PRO-GEST SPA 3.250% 15/12/2024 | EUR | 6.831.194,79 | 0,32 |
| 3.711.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 1.625% 18/01/2029 EMTN | EUR | 3.636.341,32 | 0,17 |
| 2.000.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 5.250% 17/03/2055 EMTN | EUR | 2.431.565,94 | 0,11 |
| 702.000 | VERDE BIDCO SPA 4.625% 01/10/2026 | EUR | 714.707,53 | 0,03 |
| | | | **53.312.997,60** | **2,47** |
| | **Kanada** | | | |
| 793.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 4.875% 01/06/2028 | USD | 709.514,72 | 0,03 |
| 4.796.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 6.125% 15/04/2025 | USD | 4.226.818,02 | 0,20 |
| 1.196.000 | CLARIOS GLOBAL LP 6.750% 15/05/2025 | USD | 1.092.213,46 | 0,05 |
| 9.350.000 | GARDA WORLD SECURITY CORP 9.500% 01/11/2027 | USD | 8.715.983,19 | 0,40 |
| 12.170.000 | HUSKY III HOLDING LTD 13.000% 15/02/2025 | USD | 11.158.919,72 | 0,52 |
| | | | **25.903.449,11** | **1,20** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 500.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 403.314,45 | 0,02 |
| 3.150.000 | AGILE GROUP HOLDINGS LTD FRN PERP | USD | 2.471.489,27 | 0,11 |
| 1.800.000 | CHINA HONGQIAO GROUP LTD 6.250% 08/06/2024 | USD | 1.577.789,56 | 0,07 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.000.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.000% 02/05/2025 | USD | 815.364,86 | 0,04 |
| 3.000.000 | CHINA SCE GROUP HOLDINGS LTD 7.375% 09/04/2024 | USD | 2.502.354,68 | 0,12 |
| 1.000.000 | CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD 5.250% 13/05/2026 | USD | 845.499,35 | 0,04 |
| 1.000.000 | CIFI HOLDINGS GROUP CO LTD 6.000% 16/07/2025 | USD | 864.464,14 | 0,04 |
| 11.135.451 | GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO LTD 6.500% 15/09/2024 | USD | 9.479.055,77 | 0,44 |
| 2.000.000 | TIMES CHINA HOLDINGS LTD 6.200% 22/03/2026 | USD | 1.562.333,16 | 0,07 |
| 4.165.000 | TRANSOCEAN POSEIDON LTD 6.875% 01/02/2027 | USD | 3.585.914,82 | 0,17 |
| 1.250.000 | YUZHOU GROUP HOLDINGS CO LTD 7.375% 13/01/2026 | USD | 715.815,06 | 0,03 |
| | | | **24.823.395,12** | **1,15** |
| | **Dänemark** | | | |
| 11.300.000 | DKT FINANCE APS 7.000% 17/06/2023 | EUR | 11.521.327,00 | 0,53 |
| 11.219.000 | DKT FINANCE APS 9.375% 17/06/2023 | USD | 9.877.858,98 | 0,46 |
| | | | **21.399.185,98** | **0,99** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 3.156.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC/ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP/ATLAS LUXCO 4 SARL 3.625% 01/06/2028 | EUR | 3.100.965,32 | 0,14 |
| 1.152.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC/ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP/ATLAS LUXCO 4 SARL 4.875% 01/06/2028 | GBP | 1.320.523,46 | 0,06 |
| 7.550.000 | AXALTA COATING SYSTEMS LLC / AXALTA COATING SYSTEMS DUTCH HOLDING B BV 4.750% 15/06/2027 | USD | 6.772.061,47 | 0,31 |
| 10.820.000 | CLARIOS GLOBAL LP / CLARIOS US FINANCE CO 8.500% 15/05/2027 | USD | 9.932.897,99 | 0,46 |
| | | | **21.126.448,24** | **0,97** |
| | **Panama** | | | |
| 7.725.000 | CARNIVAL CORP 10.500% 01/02/2026 | USD | 7.729.720,19 | 0,36 |
| 7.000.000 | CARNIVAL CORP 1.875% 07/11/2022 | EUR | 6.951.240,94 | 0,32 |
| 5.661.000 | CARNIVAL CORP 7.625% 01/03/2026 | USD | 5.212.983,40 | 0,24 |
| | | | **19.893.944,53** | **0,92** |
| | **Spanien** | | | |
| 6.630.000 | GRIFOLS ESCROW ISSUER SA 3.875% 15/10/2028 | EUR | 6.707.519,22 | 0,31 |
| 1.500.000 | INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 2.750% 25/03/2025 | EUR | 1.513.125,00 | 0,07 |
| 5.700.000 | INTERNATIONAL CONSOLIDATED AIRLINES GROUP SA 3.750% 25/03/2029 | EUR | 5.779.098,73 | 0,27 |
| 1.440.000 | LORCA TELECOM BONDCO SA 4.000% 18/09/2027 | EUR | 1.448.504,08 | 0,07 |
| 1.784.000 | NH HOTEL GROUP SA 4.000% 02/07/2026 | EUR | 1.807.500,47 | 0,08 |
| | | | **17.255.747,50** | **0,80** |
| | **Jersey** | | | |
| 4.000.000 | AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.500% 15/05/2025 | EUR | 4.076.560,00 | 0,19 |
| 6.825.000 | AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.750% 30/01/2026 | EUR | 6.973.815,51 | 0,32 |
| 5.000.000 | WHEEL BIDCO LTD 6.750% 15/07/2026 | GBP | 5.858.988,83 | 0,27 |
| | | | **16.909.364,34** | **0,78** |
| | **Liberia** | | | |
| 235.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 10.875% 01/06/2023 | USD | 226.877,35 | 0,01 |
| 5.347.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 11.500% 01/06/2025 | USD | 5.267.445,85 | 0,24 |
| 2.990.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.250% 15/11/2022 | USD | 2.651.942,49 | 0,12 |
| 3.090.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 9.125% 15/06/2023 | USD | 2.899.355,62 | 0,13 |
| | | | **11.045.621,31** | **0,50** |
| | **Bermuda** | | | |
| 10.250.000 | NCL CORP LTD 3.625% 15/12/2024 | USD | 8.399.366,32 | 0,39 |
| 1.072.000 | NCL CORP LTD 5.875% 15/03/2026 | USD | 948.364,36 | 0,04 |
| | | | **9.347.730,68** | **0,43** |
| | **Österreich** | | | |
| 2.400.000 | AMS AG ZCP 05/03/2025 | EUR | 2.125.844,47 | 0,10 |
| 4.400.000 | AMS AG 0.875% 28/09/2022 | USD | 3.721.342,47 | 0,17 |
| 2.560.000 | AMS AG 6.000% 31/07/2025 | EUR | 2.733.756,34 | 0,13 |
| | | | **8.580.943,28** | **0,40** |
| | **Schweden** | | | |
| 6.000.000 | VERISURE HOLDING AB 3.250% 15/02/2027 | EUR | 6.030.341,64 | 0,28 |
| 1.052.000 | VERISURE MIDHOLDING AB 5.250% 15/02/2029 | EUR | 1.079.734,95 | 0,05 |
| | | | **7.110.076,59** | **0,33** |
| | **Portugal** | | | |
| 5.500.000 | TRANSPORTES AEREOS PORTUGUESES SA 5.625% 02/12/2024 | EUR | 4.549.542,14 | 0,21 |
| | | | **4.549.542,14** | **0,21** |
| | **Irland** | | | |
| 3.620.000 | VIRGIN MEDIA VENDOR FINANCING NOTES III DAC 4.875% 15/07/2028 | GBP | 4.293.742,39 | 0,20 |
| | | | **4.293.742,39** | **0,20** |
| | **Griechenland** | | | |
| 3.000.000 | PIRAEUS FINANCIAL HOLDINGS SA FRN PERP | EUR | 3.053.824,44 | 0,14 |
| | | | **3.053.824,44** | **0,14** |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 2.850.000 | EASY TACTIC LTD 8.625% 27/02/2024 | USD | 1.622.661,05 | 0,07 |
| 1.000.000 | NEW METRO GLOBAL LTD 4.625% 15/10/2025 | USD | 796.278,17 | 0,04 |
| | | | **2.418.939,22** | **0,11** |
| | **Thailand** | | | |
| 2.600.000 | KASIKORNBANK PCL/HONG KONG FRN PERP EMTN | USD | 2.351.015,28 | 0,11 |
| | | | **2.351.015,28** | **0,11** |
| | **Singapur** | | | |
| 2.580.000 | LMIRT CAPITAL PTE LTD 7.250% 19/06/2024 | USD | 2.315.689,19 | 0,11 |
| | | | **2.315.689,19** | **0,11** |
| | **China** | | | |
| 2.800.000 | WENS FOODSTUFFS GROUP CO LTD 3.258% 29/10/2030 | USD | 1.977.247,03 | 0,09 |
| | | | **1.977.247,03** | **0,09** |
| | **Indien** | | | |
| 1.400.000 | ADANI GREEN ENERGY LTD 4.375% 08/09/2024 | USD | 1.210.519,04 | 0,06 |
| | | | **1.210.519,04** | **0,06** |
| | **Südafrika** | | | |
| 14.853.782 | K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 3.000% 31/12/2022 | USD | 12.447,47 | 0,00 |
| 24.021.272 | K2016470219 SOUTH AFRICA LTD 8.000% 31/12/2022 | EUR | 55.744,73 | 0,00 |
| | | | **68.192,20** | **0,00** |
| | **Kroatien** | | | |
| 2.656.000 | AGROKOR BOND CONVERTIBLE ZCP 15/07/2031 | EUR | 0,03 | 0,00 |
| | | | **0,03** | **0,00** |
| | | | **1.888.671.902,58** | **87,36** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 68.161 | QUIKSILVER INC | USD | 594.754,91 | 0,03 |
| | | | **594.754,91** | **0,03** |
| | **Südafrika** | | | |
| 176.579.086 | HOLDCO 2 ORDINARY A SHARES | USD | 0,00 | 0,00 |
| 28.878.638 | HOLDCO 2 ORDINARY B SHARES | USD | 0,00 | 0,00 |
| | | | **0,00** | **0,00** |
| | | | **594.754,91** | **0,03** |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 952.727 | HELIX HOLDCO SA 10.000% 19/04/2026 | EUR | 42.804,73 | 0,00 |
| | | | **42.804,73** | **0,00** |
| | **Südafrika** | | | |
| 8.753.206 | K2016470260 SOUTH AFRICA LTD 25.000% 31/12/2022 | USD | 1.438,56 | 0,00 |
| | | | **1.438,56** | **0,00** |
| | **Bermuda** | | | |
| 2.500.000 | 3D-GOLD JEWELLERY HOLDINGS LTD 9.250% 17/10/2014 - DEFAULTED | USD | 215,71 | 0,00 |
| | | | **215,71** | **0,00** |
| | | | **44.459,00** | **0,00** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| | **Luxemburg** | | | |
| 9.475 | NN (L) ASIAN HIGH YIELD - I CAP USD | USD | 54.053.032,61 | 2,50 |
| 3.800 | NN (L) EUROPEAN HIGH YIELD - Z CAP EUR | EUR | 35.950.850,00 | 1,66 |
| 17.640 | NN (L) LIQUID EUR - Z CAP EUR | EUR | 17.475.724,10 | 0,81 |
| 15.044 | NN (L) US HIGH YIELD - Z CAP USD | USD | 84.238.611,57 | 3,90 |
| | | | **191.718.218,28** | **8,87** |
| | | | **191.718.218,28** | **8,87** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **2.084.602.895,41** | **96,43** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| **Zinsswap** | | | | | |
| Floating | 2.295 | 04/05/2027 | USD | 25.000.000,00 | (1.334.803,70) |
| | | | | | **(1.334.803,70)** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 141.265.000,00 | USD | 120.860.797,39 | EUR | 29/10/2021 | 120.860.797,39 | 970.313,03 |
| 44.553.572,46 | USD | 37.650.338,09 | EUR | 19/10/2021 | 37.650.338,09 | 781.370,62 |
| 109.770.457,76 | AUD | 68.128.337,38 | EUR | 19/10/2021 | 68.128.337,38 | 273.506,21 |
| 5.165.944,43 | USD | 3.746.827,68 | GBP | 19/10/2021 | 4.376.641,15 | 98.178,28 |
| 8.551.929,85 | USD | 11.691.637,78 | AUD | 19/10/2021 | 7.274.431,60 | 91.383,90 |
| 14.072.714,93 | AUD | 7.502.342,99 | GBP | 19/10/2021 | 8.712.815,45 | 43.216,65 |
| 1.643.112,90 | EUR | 7.406.561,44 | PLN | 19/10/2021 | 1.643.112,90 | 34.369,82 |
| 26.639.705,10 | EUR | 22.885.657,27 | GBP | 19/10/2021 | 26.639.705,10 | 21.356,85 |
| 901.351,59 | EUR | 15.507.283,65 | ZAR | 19/10/2021 | 901.351,59 | 14.143,06 |
| 1.934.000,00 | CHF | 1.784.773,15 | EUR | 29/10/2021 | 1.784.773,15 | 4.352,41 |
| 6.185.000,00 | SEK | 606.605,94 | EUR | 29/10/2021 | 606.605,94 | 3.220,26 |
| 122.233,36 | USD | 111.791,69 | CHF | 19/10/2021 | 103.553,04 | 2.025,55 |
| 102.525,05 | GBP | 2.067.608,74 | ZAR | 19/10/2021 | 119.513,93 | 954,26 |
| 42.279.000,00 | GBP | 49.165.172,37 | EUR | 29/10/2021 | 49.165.172,37 | 914,79 |
| 42.685,83 | GBP | 224.737,69 | PLN | 19/10/2021 | 49.759,07 | 833,78 |
| 40.208,98 | USD | 346.291,76 | SEK | 19/10/2021 | 34.062,42 | 536,37 |
| 23.246,53 | CHF | 96.638,71 | PLN | 19/10/2021 | 21.447,71 | 513,67 |
| 92.287,60 | CHF | 84.928,93 | EUR | 19/10/2021 | 84.928,93 | 441,29 |
| 338.093,90 | AUD | 227.284,30 | CHF | 19/10/2021 | 209.323,49 | 429,93 |
| 11.484,06 | CHF | 181.130,68 | ZAR | 19/10/2021 | 10.595,41 | 260,36 |
| 37.868,98 | CHF | 55.924,30 | AUD | 19/10/2021 | 34.911,30 | 182,12 |
| 14.470,51 | SEK | 2.279,35 | AUD | 19/10/2021 | 1.423,74 | 6,59 |
| 113.725,79 | AUD | 720.055,92 | SEK | 19/10/2021 | 70.410,85 | (137,91) |
| 13.644,75 | CHF | 14.911,53 | USD | 19/10/2021 | 12.588,92 | (240,61) |
| 550.354,11 | GBP | 640.593,40 | EUR | 19/10/2021 | 640.593,40 | (475,57) |
| 482.398,22 | ZAR | 286.271,34 | SEK | 19/10/2021 | 28.253,08 | (629,97) |
| 24.332,88 | GBP | 33.679,92 | USD | 19/10/2021 | 28.364,95 | (750,53) |
| 219.649,72 | EUR | 2.240.665,48 | SEK | 19/10/2021 | 219.649,72 | (1.301,53) |
| 633.053,94 | EUR | 685.803,61 | CHF | 19/10/2021 | 633.053,94 | (1.345,53) |
| 234.528,23 | PLN | 530.641,51 | SEK | 19/10/2021 | 51.889,19 | (1.385,64) |
| 1.485.775,02 | ZAR | 93.562,04 | CHF | 19/10/2021 | 86.912,79 | (1.544,42) |
| 383.747,44 | GBP | 719.075,32 | AUD | 19/10/2021 | 447.220,71 | (1.743,87) |
| 704.111,01 | PLN | 169.162,35 | CHF | 19/10/2021 | 155.770,79 | (3.546,33) |
| 1.778.005,64 | EUR | 1.534.410,33 | GBP | 29/10/2021 | 1.778.005,64 | (6.354,27) |
| 3.431.665,64 | EUR | 5.521.896,62 | AUD | 19/10/2021 | 3.431.665,64 | (9.222,89) |
| 63.984.175,93 | ZAR | 3.195.098,52 | GBP | 19/10/2021 | 3.744.457,31 | (55.538,04) |
| 28.904.052,30 | PLN | 5.507.538,65 | GBP | 19/10/2021 | 6.395.666,18 | (127.719,69) |
| 45.427.925,74 | EUR | 52.843.092,68 | USD | 29/10/2021 | 45.427.925,74 | (145.518,92) |
| 499.613.358,34 | ZAR | 29.044.130,01 | EUR | 19/10/2021 | 29.044.130,01 | (460.063,15) |
| 231.273.126,19 | PLN | 51.272.406,83 | EUR | 19/10/2021 | 51.272.406,83 | (1.038.699,29) |
| 1.256.579.164,23 | ZAR | 86.484.816,13 | USD | 19/10/2021 | 73.525.585,25 | (2.709.530,09) |
| 280.258.111,11 | AUD | 206.037.355,55 | USD | 19/10/2021 | 173.515.715,65 | (3.088.171,55) |
| 584.977.112,63 | PLN | 153.632.119,17 | USD | 19/10/2021 | 129.402.507,98 | (5.462.341,40) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global High Yield

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | Zu zahlen | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| 531.756.214,65 EUR | 629.146.631,35 USD | 19/10/2021 | 531.756.214,65 | (10.942.804,52) |
| | | | **1.380.082.590,37** | **(21.716.555,92)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(23.051.359,62)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **2.084.602.895,41** | **96,43** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(23.051.359,62)** | **(1,07)** |
| **Bankguthaben** | **69.061.823,01** | **3,19** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **31.151.243,36** | **1,45** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **2.161.764.602,16** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Inflation Linked Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 199.868.917,96 |
| | 30.09.2020 | EUR | 164.269.474,91 |
| | 30.09.2019 | EUR | 165.467.862,21 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.307,81 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.146,96 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.975,57 |
| Capitalisation N Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 348,84 |
| | 30.09.2020 | EUR | 341,28 |
| | 30.09.2019 | EUR | 333,25 |
| Capitalisation P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 339,89 |
| | 30.09.2020 | EUR | 333,62 |
| | 30.09.2019 | EUR | 326,75 |
| Capitalisation R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 343,82 |
| | 30.09.2020 | EUR | 336,44 |
| | 30.09.2019 | EUR | 328,50 |
| Capitalisation R Hedged (iii) (SEK) | 30.09.2021 | SEK | 2.561,89 |
| | 30.09.2020 | SEK | - |
| | 30.09.2019 | SEK | - |
| Capitalisation X Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 336,63 |
| | 30.09.2020 | EUR | 330,67 |
| | 30.09.2019 | EUR | 324,10 |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.193,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.171,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.146,60 |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.196,50 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.170,74 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.149,33 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | | 7.979 |
| | 30.09.2020 | | 5.666 |
| | 30.09.2019 | | 5.760 |
| Capitalisation N Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | | 344.757 |
| | 30.09.2020 | | 313.782 |
| | 30.09.2019 | | 329.096 |
| Capitalisation P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | | 12.556 |
| | 30.09.2020 | | 14.484 |
| | 30.09.2019 | | 15.410 |
| Capitalisation R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | | 2.113 |
| | 30.09.2020 | | 2.113 |
| | 30.09.2019 | | 2.138 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation R Hedged (iii) (SEK) | 30.09.2021 | 4.061 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation X Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 17.488 |
| | 30.09.2020 | 20.481 |
| | 30.09.2019 | 5.938 |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 7.002 |
| | 30.09.2020 | 2.850 |
| | 30.09.2019 | 5.941 |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 862 |
| | 30.09.2020 | 882 |
| | 30.09.2019 | 995 |
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,51% |
| Capitalisation N Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,57% |
| Capitalisation P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,87% |
| Capitalisation R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,58% |
| Capitalisation R Hedged (iii) (SEK) | 30.09.2021 | 0,58% |
| Capitalisation X Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,97% |
| Distribution P Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,87% |
| Distribution R Hedged (iii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,58% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (20,78%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Inflation Linked Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **192.646.279,57** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 192.646.279,57 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **196.118,68** |
| Zinsswaps | | 67.418,61 |
| Futures | | 128.700,07 |
| **Bankguthaben** | | **6.700.333,95** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **1.128.944,58** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **3.268.080,25** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***203.939.757,03*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(2.164.325,95)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(1.906.513,12)** |
| Devisentermingeschäfte | | (1.906.513,12) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(4.070.839,07)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***199.868.917,96*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **4.555.879,84** |
| Dividenden | | 61,80 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 4.504.664,44 |
| Zinsen auf Swaps | | 51.153,60 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.203.226,98)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (713.550,47) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (261.762,47) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (38.641,82) |
| Abonnementsteuer | 9 | (72.935,90) |
| Bankzinsen | | (53.386,65) |
| Zinsen auf Swaps | | (62.949,67) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **3.352.652,86** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 1.642.502,76 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (207.744,13) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 10.984.409,72 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (15.626.816,11) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 2.302.886,44 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (2.227.112,21) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 4.539.388,60 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (566.695,01) |
| **Ergebnis** | | **4.193.472,92** |
| Zeichnungen | | 59.726.834,63 |
| Rücknahmen | | (28.320.864,50) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 164.269.474,91 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***199.868.917,96*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Inflation Linked Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 59.137 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/01/2023 | USD | 52.751,13 | 0,03 |
| 4.564.852 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/01/2030 | USD | 4.328.493,69 | 2,16 |
| 1.258.488 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/01/2031 | USD | 1.192.327,18 | 0,60 |
| 524.295 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/02/2051 | USD | 496.071,37 | 0,25 |
| 3.617.837 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/04/2025 | USD | 3.348.588,32 | 1,68 |
| 1.543.424 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/07/2024 | USD | 1.421.626,73 | 0,71 |
| 2.560.315 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/07/2026 | USD | 2.409.888,72 | 1,21 |
| 489.803 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/07/2030 | USD | 466.246,78 | 0,23 |
| 2.032.374 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/10/2024 | USD | 1.875.675,72 | 0,94 |
| 1.763.509 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.250% 15/01/2025 | USD | 1.634.752,67 | 0,82 |
| 1.008.786 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.250% 15/02/2050 | USD | 981.298,41 | 0,49 |
| 2.372.227 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.375% 15/01/2027 | USD | 2.260.155,55 | 1,13 |
| 2.354.432 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.375% 15/07/2023 | USD | 2.140.166,05 | 1,07 |
| 3.119.779 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.375% 15/07/2025 | USD | 2.936.871,21 | 1,47 |
| 2.656.175 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.375% 15/07/2027 | USD | 2.549.817,33 | 1,28 |
| 1.172.069 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.500% 15/01/2028 | USD | 1.132.473,46 | 0,57 |
| 1.212.344 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.500% 15/04/2024 | USD | 1.116.953,76 | 0,56 |
| 3.410.637 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.625% 15/01/2024 | USD | 3.139.647,94 | 1,57 |
| 5.719.473 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.625% 15/01/2026 | USD | 5.446.691,02 | 2,72 |
| 1.899.888 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.625% 15/02/2043 | USD | 1.952.850,68 | 0,98 |
| 1.864.040 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.625% 15/04/2023 | USD | 1.682.975,14 | 0,84 |
| 1.751.876 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.750% 15/02/2042 | USD | 1.840.565,64 | 0,92 |
| 1.739.010 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.750% 15/02/2045 | USD | 1.845.918,31 | 0,92 |
| 924.452 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.750% 15/07/2028 | USD | 913.552,09 | 0,46 |
| 2.296.448 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.875% 15/01/2029 | USD | 2.290.026,64 | 1,15 |
| 1.357.140 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.875% 15/02/2047 | USD | 1.500.657,51 | 0,75 |
| 846.230 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.000% PERP | USD | 979.128,87 | 0,49 |
| 1.417.181 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.000% 15/02/2046 | USD | 1.592.129,77 | 0,80 |
| 1.151.363 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.000% 15/02/2048 | USD | 1.318.219,94 | 0,66 |
| 1.710.229 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.375% 15/02/2044 | USD | 2.026.242,80 | 1,01 |
| 3.648.010 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 1.750% 15/01/2028 | USD | 3.788.913,93 | 1,89 |
| 2.930.206 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.000% 15/01/2026 | USD | 2.947.956,20 | 1,47 |
| 1.225.197 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.125% 15/02/2040 | USD | 1.573.052,41 | 0,79 |
| 1.869.960 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.125% 15/02/2041 | USD | 2.429.318,53 | 1,22 |
| 5.607.895 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.375% 15/01/2025 | USD | 5.553.254,22 | 2,77 |
| 1.559.520 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.375% 15/01/2027 | USD | 1.636.564,53 | 0,82 |
| 1.818.331 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 2.500% 15/01/2029 | USD | 2.009.817,81 | 1,01 |
| 553.698 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 3.375% 15/04/2032 | USD | 699.335,24 | 0,35 |
| 1.687.910 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 3.625% 15/04/2028 | USD | 1.946.917,49 | 0,97 |
| 4.678.107 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 3.875% 15/04/2029 | USD | 5.631.521,58 | 2,81 |
| | | | **85.089.416,37** | **42,57** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 1.334.765 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 10/08/2028 | GBP | 1.935.576,57 | 0,97 |
| 850.871 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 10/08/2041 | GBP | 1.615.104,63 | 0,81 |
| 811.570 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 10/08/2048 | GBP | 1.742.736,90 | 0,87 |
| 924.994 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2024 | GBP | 1.187.529,97 | 0,59 |
| 993.720 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2026 | GBP | 1.350.374,13 | 0,68 |
| 1.276.581 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2029 | GBP | 1.871.388,12 | 0,94 |
| 123.548 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2039 | GBP | 222.669,85 | 0,11 |
| 1.222.394 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2044 | GBP | 2.403.558,11 | 1,20 |
| 995.459 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2046 | GBP | 2.026.886,57 | 1,01 |
| 238.906 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2051 | GBP | 534.953,15 | 0,27 |
| 811.845 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2058 | GBP | 2.088.220,13 | 1,04 |
| 954.307 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/03/2068 | GBP | 3.105.300,44 | 1,55 |
| 964.431 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/11/2036 | GBP | 1.673.570,84 | 0,84 |
| 490.170 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/11/2056 | GBP | 1.224.481,72 | 0,61 |
| 598.250 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.125% 22/11/2065 | GBP | 1.811.433,82 | 0,91 |
| 946.605 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.250% 22/03/2052 | GBP | 2.228.630,05 | 1,12 |
| 1.010.435 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.375% 22/03/2062 | GBP | 2.987.125,10 | 1,49 |
| 1.055.713 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.500% 22/03/2050 | GBP | 2.515.627,20 | 1,26 |
| 1.312.174 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.625% 22/03/2040 | GBP | 2.595.862,80 | 1,30 |
| 1.121.554 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.625% 22/11/2042 | GBP | 2.353.949,06 | 1,18 |
| 1.447.061 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.750% 22/03/2034 | GBP | 2.521.234,16 | 1,27 |
| 1.029.280 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 0.750% 22/11/2047 | GBP | 2.441.391,94 | 1,22 |
| 1.163.131 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 1.125% 22/11/2037 | GBP | 2.340.753,88 | 1,17 |
| 1.290.844 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 1.250% 22/11/2027 | GBP | 1.957.613,77 | 0,98 |
| 1.224.073 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 1.250% 22/11/2032 | GBP | 2.167.271,30 | 1,08 |
| 1.001.379 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 1.250% 22/11/2055 | GBP | 3.132.827,19 | 1,57 |
| 1.152.732 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 1.875% 22/11/2022 | GBP | 1.456.285,42 | 0,73 |
| 560.000 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 2.000% 26/01/2035 | GBP | 1.958.741,60 | 0,98 |
| 380.000 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 2.500% 17/07/2024 | GBP | 1.613.521,80 | 0,81 |
| 366.000 | UNITED KINGDOM INFLATION-LINKED GILT 4.125% 22/07/2030 | GBP | 1.619.770,67 | 0,81 |
| | | | **58.684.390,89** | **29,37** |
| **Frankreich** | | | | |
| 254.121 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 01/03/2025 | EUR | 271.708,81 | 0,14 |
| 1.055.080 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 01/03/2028 | EUR | 1.179.881,12 | 0,59 |
| 894.166 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 25/07/2036 | EUR | 1.103.605,49 | 0,55 |
| 960.705 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 25/07/2047 | EUR | 1.295.139,97 | 0,65 |
| 1.043.011 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.250% 25/07/2024 | EUR | 1.130.062,79 | 0,57 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Inflation Linked Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 504.084 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.700% 25/07/2030 | EUR | 622.820,04 | 0,31 |
| 1.060.799 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.800% 25/07/2040 | EUR | 1.749.756,84 | 0,88 |
| 1.943.661 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.850% 25/07/2027 | EUR | 2.422.396,31 | 1,21 |
| 4.110.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.000% 25/05/2048 | EUR | 5.278.175,03 | 2,64 |
| 1.101.478 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 2.100% 25/07/2023 | EUR | 1.188.306,55 | 0,59 |
| 804.974 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.150% 25/07/2032 | EUR | 1.259.469,90 | 0,63 |
| 592.157 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.400% 25/07/2029 | EUR | 846.262,33 | 0,42 |
| | | | **18.347.585,18** | **9,18** |
| | **Italien** | | | |
| 358.936 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 0.150% 15/05/2051 | EUR | 362.104,46 | 0,18 |
| 870.730 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.250% 15/09/2032 | EUR | 1.054.504,10 | 0,53 |
| 609.891 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.300% 15/05/2028 | EUR | 709.058,31 | 0,35 |
| 1.085.588 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.350% 15/09/2024 | EUR | 1.230.868,44 | 0,62 |
| 1.022.856 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.350% 15/09/2035 | EUR | 1.426.577,52 | 0,71 |
| 945.901 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.550% 15/09/2041 | EUR | 1.469.573,17 | 0,74 |
| 1.117.279 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 2.600% 15/09/2023 | EUR | 1.231.499,96 | 0,61 |
| 1.077.528 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 3.100% 15/09/2026 | EUR | 1.337.810,84 | 0,67 |
| | | | **8.821.996,80** | **4,41** |
| | **Deutschland** | | | |
| 963.473 | DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.100% 15/04/2023 | EUR | 1.000.100,65 | 0,50 |
| 1.142.532 | DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.100% 15/04/2026 | EUR | 1.273.124,68 | 0,64 |
| 651.576 | DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.100% 15/04/2046 | EUR | 996.020,21 | 0,50 |
| 1.323.882 | DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.500% 15/04/2030 | EUR | 1.636.066,16 | 0,81 |
| | | | **4.905.311,70** | **2,45** |
| | **Spanien** | | | |
| 750.457 | SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 0.650% 30/11/2027 | EUR | 869.251,81 | 0,43 |
| 761.489 | SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 0.700% 30/11/2033 | EUR | 938.642,54 | 0,47 |
| 1.021.046 | SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 1.000% 30/11/2030 | EUR | 1.258.651,87 | 0,64 |
| 606.175 | SPAIN GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 1.800% 30/11/2024 | EUR | 688.285,80 | 0,34 |
| | | | **3.754.832,02** | **1,88** |
| | **Kanada** | | | |
| 607.104 | CANADIAN GOVERNMENT REAL RETURN BOND 1.250% 01/12/2047 | CAD | 516.174,95 | 0,26 |
| 429.784 | CANADIAN GOVERNMENT REAL RETURN BOND 4.000% 01/12/2031 | CAD | 424.225,50 | 0,21 |
| 582.376 | CANADIAN GOVERNMENT REAL RETURN BOND 4.250% 01/12/2021 | CAD | 400.813,73 | 0,20 |
| 665.923 | CANADIAN GOVERNMENT REAL RETURN BOND 4.250% 01/12/2026 | CAD | 578.301,17 | 0,29 |
| | | | **1.919.515,35** | **0,96** |
| | **Australien** | | | |
| 350.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 1.000% 21/02/2050 | AUD | 265.874,70 | 0,13 |
| 584.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.000% 21/08/2035 | AUD | 545.361,76 | 0,28 |
| 264.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 2.500% 20/09/2030 | AUD | 261.313,44 | 0,13 |
| 543.000 | AUSTRALIA GOVERNMENT BOND 3.000% 20/09/2025 | AUD | 506.747,71 | 0,25 |
| | | | **1.579.297,61** | **0,79** |
| | **Schweden** | | | |
| 5.200.000 | SWEDEN INFLATION LINKED BOND 1.000% 01/06/2025 | SEK | 622.832,33 | 0,31 |
| 3.505.000 | SWEDEN INFLATION LINKED BOND 3.500% 01/12/2028 | SEK | 649.685,03 | 0,33 |
| | | | **1.272.517,36** | **0,64** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 540.000 | NEW ZEALAND GOVERNMENT BOND 2.000% 20/09/2025 | NZD | 396.877,43 | 0,20 |
| 260.000 | NEW ZEALAND GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 2.500% 20/09/2035 | NZD | 216.764,62 | 0,11 |
| 597.000 | NEW ZEALAND GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 3.000% 20/09/2030 | NZD | 500.535,94 | 0,25 |
| | | | **1.114.177,99** | **0,56** |
| | | | **185.489.041,27** | **92,81** |

### Sonstige übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente

#### Anleihen und andere Schuldtitel

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Japan** | | | |
| 86.711.050 | JAPANESE GOVERNMENT CPI LINKED BOND 0.100% 10/03/2025 | JPY | 683.645,01 | 0,34 |
| 101.914.000 | JAPANESE GOVERNMENT CPI LINKED BOND 0.100% 10/03/2026 | JPY | 806.660,16 | 0,40 |
| 111.409.990 | JAPANESE GOVERNMENT CPI LINKED BOND 0.100% 10/03/2027 | JPY | 887.423,73 | 0,44 |
| 202.596.000 | JAPANESE GOVERNMENT CPI LINKED BOND 0.100% 10/03/2028 | JPY | 1.611.498,57 | 0,81 |
| 93.907.084 | JAPANESE GOVERNMENT CPI LINKED BOND 0.100% 10/09/2023 | JPY | 738.204,58 | 0,37 |
| 90.616.240 | JAPANESE GOVERNMENT CPI LINKED BOND 0.100% 10/09/2024 | JPY | 716.539,44 | 0,36 |
| | | | **5.443.971,49** | **2,72** |
| | **Kanada** | | | |
| 626.564 | CANADIAN GOVERNMENT REAL RETURN BOND 1.500% 01/12/2044 | CAD | 546.357,31 | 0,27 |
| 565.521 | CANADIAN GOVERNMENT REAL RETURN BOND 2.000% 01/12/2041 | CAD | 526.062,66 | 0,26 |
| 453.188 | CANADIAN GOVERNMENT REAL RETURN BOND 3.000% 01/12/2036 | CAD | 450.109,08 | 0,23 |
| | | | **1.522.529,05** | **0,76** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 230.000 | NEW ZEALAND GOVERNMENT INFLATION LINKED BOND 2.500% 20/09/2040 | NZD | 190.737,76 | 0,10 |
| | | | **190.737,76** | **0,10** |
| | | | **7.157.238,30** | **3,58** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **192.646.279,57** | **96,39** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| | | **Zinsswaps** | | | |
| Floating | 1.016 | 24/12/2050 | USD | 4.100.000,00 | 686.962,39 |
| Floating | 1.676 | 19/07/2051 | USD | 2.180.000,00 | 72.912,16 |
| Floating | 0,078 | 15/04/2031 | EUR | 6.627.000,00 | 37.874,23 |
| 1.324 | Floating | 19/07/2031 | USD | 4.660.000,00 | (79.426,79) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Inflation Linked Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten (%) | Zu zahlen (%) | Fälligkeits-datum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|
| 0.738 | Floating | 24/12/2030 | USD | 11.250.000,00 | (650.903,38) |
| | | | | | **67.418,61** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 10.160.000,00 | USD | 8.575.795,81 | EUR | 17/12/2021 | 8.575.795,81 | 176.562,42 |
| 64.651.686,03 | EUR | 55.530.818,17 | GBP | 19/10/2021 | 64.651.686,03 | 63.693,70 |
| 3.340.000,00 | CAD | 2.224.629,51 | EUR | 17/12/2021 | 2.224.629,51 | 46.532,24 |
| 2.876.271,76 | USD | 2.464.036,48 | EUR | 19/10/2021 | 2.464.036,48 | 17.022,44 |
| 1.037.859,15 | EUR | 4.730.000,00 | PLN | 17/12/2021 | 1.037.859,15 | 12.061,76 |
| 1.236.340,48 | USD | 34.056.000,00 | TWD | 17/12/2021 | 1.049.257,81 | 6.632,75 |
| 1.755.000,00 | AUD | 1.087.188,97 | EUR | 17/12/2021 | 1.087.188,97 | 5.311,24 |
| 304.563.000,00 | JPY | 2.347.988,11 | EUR | 17/12/2021 | 2.347.988,11 | 5.155,13 |
| 281.801,78 | EUR | 470.000,00 | NZD | 17/12/2021 | 281.801,78 | 2.662,62 |
| 690.397,74 | USD | 2.216.000,00 | ILS | 17/12/2021 | 585.926,96 | 2.586,85 |
| 91.297.000,00 | RUB | 1.233.144,83 | USD | 17/12/2021 | 1.064.020,38 | 2.520,88 |
| 3.324.717,30 | SEK | 279.936,00 | GBP | 19/10/2021 | 326.061,26 | 2.255,17 |
| 47.082.000,00 | NOK | 4.641.512,48 | EUR | 17/12/2021 | 4.641.512,48 | 1.789,48 |
| 189.224,53 | CAD | 127.285,75 | EUR | 19/10/2021 | 127.285,75 | 1.553,59 |
| 2.133.384,18 | SEK | 209.118,22 | EUR | 19/10/2021 | 209.118,22 | 1.254,05 |
| 1.008.928,42 | EUR | 1.694.526,57 | NZD | 19/10/2021 | 1.008.928,42 | 660,36 |
| 2.310.187,92 | EUR | 298.930.000,00 | JPY | 17/12/2021 | 2.310.187,92 | 566,89 |
| 115.143,53 | AUD | 71.298,00 | EUR | 19/10/2021 | 71.298,00 | 452,00 |
| 7.473.027,00 | JPY | 57.466,88 | EUR | 19/10/2021 | 57.466,88 | 313,78 |
| 440.556,55 | EUR | 3.274.903,24 | DKK | 19/10/2021 | 440.556,55 | 150,05 |
| 7.117,10 | USD | 8.349.000,00 | KRW | 17/12/2021 | 6.040,14 | 60,67 |
| 3.300.000,00 | DKK | 443.713,36 | EUR | 17/12/2021 | 443.713,36 | 37,40 |
| 52.082,21 | SEK | 8.571,74 | NZD | 19/10/2021 | 5.107,52 | 35,50 |
| 101.205,70 | SEK | 15.982,72 | AUD | 19/10/2021 | 9.924,85 | 20,46 |
| 22.996,49 | SEK | 16.757,00 | DKK | 19/10/2021 | 2.255,23 | 14,21 |
| 588,50 | CAD | 4.039,96 | SEK | 19/10/2021 | 395,69 | 2,32 |
| 41.106,17 | DKK | 5.527,63 | EUR | 19/10/2021 | 5.527,63 | 0,30 |
| 356,85 | AUD | 2.253,60 | SEK | 19/10/2021 | 221,21 | 0,14 |
| 13.707,44 | GBP | 161.955,74 | SEK | 19/10/2021 | 15.977,21 | (27,25) |
| 24.651,03 | NZD | 14.708,90 | EUR | 19/10/2021 | 14.708,90 | (41,17) |
| 285.087,55 | SEK | 3.643.524,00 | JPY | 19/10/2021 | 27.957,10 | (58,96) |
| 180.169,89 | SEK | 26.328,89 | CAD | 19/10/2021 | 17.669,52 | (160,34) |
| 17.800.000.000,00 | IDR | 1.236.497,52 | USD | 17/12/2021 | 1.059.919,94 | (2.887,42) |
| 530.000,00 | GBP | 618.644,31 | EUR | 17/12/2021 | 618.644,31 | (2.940,85) |
| 4.013.918,40 | GBP | 4.674.165,16 | EUR | 19/10/2021 | 4.674.165,16 | (5.569,60) |
| 456.301,00 | EUR | 1.730.000,00 | ILS | 17/12/2021 | 456.301,00 | (5.988,47) |
| 1.050.192,74 | EUR | 10.710.000,00 | NOK | 17/12/2021 | 1.050.192,74 | (6.044,55) |
| 1.056.418,42 | EUR | 1.564.000,00 | CAD | 17/12/2021 | 1.056.418,42 | (7.083,67) |
| 4.722.430,70 | SEK | 548.343,94 | USD | 19/10/2021 | 463.117,22 | (7.321,74) |
| 1.257.328,27 | EUR | 12.827.757,45 | SEK | 19/10/2021 | 1.257.328,27 | (7.612,44) |
| 2.601.698,50 | EUR | 2.820.000,00 | CHF | 17/12/2021 | 2.601.698,50 | (7.653,71) |
| 1.954.887,34 | EUR | 3.150.093,73 | AUD | 19/10/2021 | 1.954.887,34 | (8.047,16) |
| 1.635.871,98 | EUR | 16.687.000,00 | SEK | 17/12/2021 | 1.635.871,98 | (8.535,35) |
| 1.559.278,37 | EUR | 2.520.000,00 | AUD | 17/12/2021 | 1.559.278,37 | (9.439,90) |
| 24.850.000,00 | MXN | 1.233.628,36 | USD | 17/12/2021 | 1.062.392,08 | (32.314,27) |
| 2.467.510,68 | EUR | 2.910.000,00 | USD | 17/12/2021 | 2.467.510,68 | (39.316,34) |
| 5.514.757,66 | EUR | 719.071.867,00 | JPY | 19/10/2021 | 5.514.757,66 | (45.030,51) |
| 3.476.706,28 | EUR | 5.182.754,13 | CAD | 19/10/2021 | 3.476.706,28 | (52.131,15) |
| 91.914.503,57 | EUR | 108.883.858,17 | USD | 19/10/2021 | 91.914.503,57 | (2.008.216,67) |
| | | | | | **217.935.798,35** | **(1.906.513,12)** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| 117 | AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/12/2021 | AUD | 10.316.706,15 | (186.520,68) |
| (3) | CANADA 10YR BOND FUTURE 20/12/2021 | CAD | 292.497,87 | 370,26 |
| 72 | EURO-BTP FUTURE 08/12/2021 | EUR | 10.940.400,00 | (167.384,71) |
| 98 | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 16.642.360,00 | (19.059,43) |
| (29) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 5.896.860,00 | 194.459,02 |
| (76) | EURO-OAT FUTURE 08/12/2021 | EUR | 12.612.200,00 | 121.204,82 |
| (7) | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 1.019.217,35 | 3.247,91 |
| (4) | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 549.527,59 | 1.859,47 |
| 44 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 7.253.764,18 | (229.599,74) |
| (10) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 1.135.591,48 | (1.364,80) |
| (174) | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 21.807.239,31 | 411.487,95 |
| | | | **88.466.363,93** | **128.700,07** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(1.710.394,44)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **192.646.279,57** | **96,39** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(1.710.394,44)** | **(0,86)** |
| **Bankguthaben** | **6.700.333,95** | **3,35** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **2.232.698,88** | **1,12** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **199.868.917,96** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Investment Grade Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 101.191.213,59 |
| | 30.09.2020 | USD | 112.499.245,33 |
| | 30.09.2019 | USD | 113.564.931,22 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.706,69 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.429,14 |
| | 30.09.2019 | EUR | 7.351,50 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 7.038,23 |
| | 30.09.2020 | USD | 6.863,84 |
| | 30.09.2019 | USD | 6.314,54 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 7.763,46 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.521.460,91 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.419.025,50 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.382.288,08 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 335 |
| | 30.09.2020 | | 393 |
| | 30.09.2019 | | 407 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 70 |
| | 30.09.2020 | | 6 |
| | 30.09.2019 | | 6 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | - |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | 6 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | | 33 |
| | 30.09.2020 | | 38 |
| | 30.09.2019 | | 42 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,49% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 0,49% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | | 0,01% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 91,19% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Investment Grade Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **97.454.993,96** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 97.454.993,96 |
| **Bankguthaben** | | **2.606.980,16** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **434.114,35** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **872.359,17** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***101.368.447,64*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(72.374,81)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(104.859,24)** |
| Devisentermingeschäfte | | (30.822,57) |
| Futures | | (74.036,67) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(177.234,05)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***101.191.213,59*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **3.051.445,76** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 2.965.311,42 |
| Zinsen auf Swaps | | 58.333,33 |
| Sonstige Erträge | 10 | 27.801,01 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(32.113,70)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (12.415,37) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (4.138,75) |
| Abonnementsteuer | 9 | (10.808,51) |
| Bankzinsen | | (4.751,07) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **3.019.332,06** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 4.934.472,65 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (587.990,01) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 2.989.232,20 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (4.461.247,23) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 231.601,87 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (237.397,59) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (3.046.691,69) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 290.620,97 |
| **Ergebnis** | | **3.131.933,23** |
| Zeichnungen | | 1.325.799,70 |
| Rücknahmen | | (15.765.764,67) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 112.499.245,33 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***101.191.213,59*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Investment Grade Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 1.000.000 | ABBVIE INC 4.050% 21/11/2039 | USD | 1.148.708,72 | 1,14 |
| 500.000 | AMERICAN TOWER CORP 3.950% 15/03/2029 | USD | 556.774,41 | 0,55 |
| 1.000.000 | AT&T INC 4.850% 01/03/2039 | USD | 1.198.305,71 | 1,18 |
| 1.700.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/10/2030 FRN | USD | 1.774.686,70 | 1,75 |
| 2.000.000 | BANK OF AMERICA CORP 29/04/2031 FRN | USD | 2.040.077,68 | 2,02 |
| 1.750.000 | BOARDWALK PIPELINES LP 4.450% 15/07/2027 | USD | 1.968.815,49 | 1,95 |
| 491.000 | BOOKING HOLDINGS INC 4.625% 13/04/2030 | USD | 583.920,13 | 0,58 |
| 1.500.000 | BRIXMOR OPERATING PARTNERSHIP LP 4.050% 01/07/2030 | USD | 1.670.475,41 | 1,65 |
| 1.000.000 | BROADCOM INC 3.419% 15/04/2033 | USD | 1.036.322,88 | 1,02 |
| 500.000 | BROADCOM INC 5.000% 15/04/2030 | USD | 584.278,10 | 0,58 |
| 1.500.000 | BROWN & BROWN INC 2.375% 15/03/2031 | USD | 1.495.065,66 | 1,48 |
| 1.000.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 3.700% 01/04/2051 | USD | 968.152,74 | 0,96 |
| 1.000.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 4.800% 01/03/2050 | USD | 1.126.427,71 | 1,11 |
| 1.000.000 | CITIGROUP INC 20/03/2030 FRN | USD | 1.124.230,18 | 1,11 |
| 500.000 | CITIGROUP INC 29/01/2031 FRN | USD | 513.060,84 | 0,51 |
| 1.500.000 | CITIGROUP INC 31/03/2031 FRN | USD | 1.731.419,76 | 1,71 |
| 1.500.000 | CITIZENS FINANCIAL GROUP INC 3.250% 30/04/2030 | USD | 1.607.956,49 | 1,59 |
| 1.500.000 | DAE FUNDING LLC 3.375% 20/03/2028 | USD | 1.547.241,44 | 1,53 |
| 1.500.000 | DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 5.300% 01/10/2029 | USD | 1.813.893,56 | 1,79 |
| 2.000.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 3.125% 24/03/2031 | USD | 2.073.772,50 | 2,04 |
| 650.000 | DOMINION ENERGY INC 6.300% 15/03/2033 | USD | 871.869,56 | 0,86 |
| 1.500.000 | FULTON FINANCIAL CORP 15/03/2030 FRN | USD | 1.527.179,79 | 1,51 |
| 1.200.000 | GENERAL MOTORS CO 5.000% 01/04/2035 | USD | 1.419.150,98 | 1,40 |
| 2.000.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC 27/01/2032 FRN | USD | 1.926.782,88 | 1,90 |
| 4.000.000 | JPMORGAN CHASE & CO 13/05/2031 FRN | USD | 4.165.264,00 | 4,11 |
| 1.000.000 | MASCO CORP 2.000% 01/10/2030 | USD | 967.078,25 | 0,96 |
| 1.000.000 | MOHAWK INDUSTRIES INC 3.850% 01/02/2023 | USD | 1.036.319,17 | 1,02 |
| 1.000.000 | MORGAN STANLEY 22/07/2028 FRN | USD | 1.098.622,57 | 1,09 |
| 1.500.000 | MPLX LP 4.700% 15/04/2048 | USD | 1.728.643,97 | 1,71 |
| 1.000.000 | ORACLE CORP 3.600% 01/04/2050 | USD | 1.001.067,68 | 0,99 |
| 500.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 3.550% 15/12/2029 | USD | 525.866,91 | 0,52 |
| 1.000.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.900% 15/02/2045 | USD | 1.085.490,12 | 1,07 |
| 1.000.000 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC 01/10/2050 FRN | USD | 1.047.915,11 | 1,04 |
| 1.500.000 | SAMMONS FINANCIAL GROUP INC 4.450% 12/05/2027 | USD | 1.675.221,86 | 1,66 |
| 500.000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 2.000% 15/10/2031 | USD | 489.722,12 | 0,48 |
| 380.000 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC 2.875% 24/07/2037 | EUR | 541.391,36 | 0,54 |
| 1.500.000 | T-MOBILE USA INC 3.000% 15/02/2041 | USD | 1.454.430,41 | 1,44 |
| 1.313.000 | VALLEY NATIONAL BANCORP 15/06/2031 FRN | USD | 1.332.474,97 | 1,32 |
| 1.000.000 | VMWARE INC 4.700% 15/05/2030 | USD | 1.178.590,39 | 1,16 |
| 606.000 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC 4.100% 15/04/2050 | USD | 673.201,68 | 0,67 |
| 1.350.000 | WEBSTER FINANCIAL CORP 4.375% 15/02/2024 | USD | 1.441.283,72 | 1,42 |
| 1.250.000 | ZIONS BANCORP NA 4.500% 13/06/2023 | USD | 1.320.172,09 | 1,30 |
| | | | **55.071.325,70** | **54,42** |
| **Frankreich** | | | | |
| 500.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 1.250% 03/06/2030 | EUR | 606.398,16 | 0,60 |
| 1.200.000 | BNP PARIBAS SA 23/01/2027 FRN EMTN | EUR | 1.498.649,52 | 1,48 |
| 1.000.000 | BNP PARIBAS SA 2.375% 17/02/2025 EMTN | EUR | 1.246.232,11 | 1,23 |
| 400.000 | CCR RE SA 15/07/2040 FRN | EUR | 507.683,53 | 0,50 |
| 300.000 | CIE DE SAINT-GOBAIN 1.875% 21/09/2028 EMTN | EUR | 387.096,40 | 0,38 |
| 500.000 | ELO SACA 3.250% 23/07/2027 EMTN | EUR | 663.272,65 | 0,66 |
| 300.000 | EUTELSAT SA 1.500% 13/10/2028 | EUR | 354.289,64 | 0,35 |
| 500.000 | ORANGE SA 1.375% 04/09/2049 EMTN | EUR | 587.938,49 | 0,58 |
| 620.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 735.704,32 | 0,73 |
| 795.000 | TOTALENERGIES SE FRN PERP EMTN | EUR | 941.613,71 | 0,93 |
| 200.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 2.000% 29/06/2032 EMTN | EUR | 253.674,74 | 0,25 |
| 500.000 | WPP FINANCE SA 2.375% 19/05/2027 EMTN | EUR | 647.319,53 | 0,64 |
| | | | **8.429.872,80** | **8,33** |
| **Niederlande** | | | | |
| 135.000 | ALLIANDER NV FRN PERP | EUR | 162.579,84 | 0,16 |
| 1.185.000 | ARGENTUM NETHERLANDS BV FOR SWISS RE LTD 15/08/2050 FRN | USD | 1.345.343,95 | 1,33 |
| 419.000 | EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN | EUR | 522.116,45 | 0,52 |
| 385.000 | ELM BV FOR SWISS REINSURANCE CO LTD FRN PERP | EUR | 479.102,68 | 0,47 |
| 450.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 19/10/2027 EMTN | EUR | 553.335,30 | 0,55 |
| 300.000 | ING GROEP NV 26/05/2031 FRN EMTN | EUR | 368.834,48 | 0,36 |
| 300.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE II BV 1.625% 17/09/2031 | EUR | 374.924,66 | 0,37 |
| 200.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV FRN PERP | EUR | 234.028,86 | 0,23 |
| 500.000 | VONOVIA FINANCE BV 1.000% 09/07/2030 EMTN | EUR | 594.013,91 | 0,59 |
| | | | **4.634.280,13** | **4,58** |
| **Australien** | | | | |
| 700.000 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UNITED KINGDOM FRN PERP | USD | 819.979,45 | 0,81 |
| 200.000 | COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA 12/09/2034 FRN EMTN | USD | 211.786,86 | 0,21 |
| 800.000 | QBE INSURANCE GROUP LTD 17/06/2046 FRN EMTN | USD | 904.546,04 | 0,90 |
| 450.000 | SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031 | USD | 457.524,15 | 0,45 |
| 500.000 | SANTOS FINANCE LTD 5.250% 13/03/2029 EMTN | USD | 560.476,96 | 0,55 |
| 600.000 | SCENTRE GROUP TRUST 2 24/09/2080 FRN | USD | 647.218,59 | 0,64 |
| 600.000 | WESTPAC BANKING CORP 24/07/2034 FRN | USD | 651.749,54 | 0,64 |
| | | | **4.253.281,59** | **4,20** |
| **Deutschland** | | | | |
| 800.000 | MERCK KGAA 09/09/2080 FRN | EUR | 953.904,68 | 0,94 |
| 325.000 | SYMRISE AG 1.250% 29/11/2025 | EUR | 393.951,87 | 0,39 |
| 300.000 | VOLKSWAGEN BANK GMBH 1.250% 10/06/2024 EMTN | EUR | 359.201,48 | 0,35 |
| 148.000 | VOLKSWAGEN FINANCIAL SERVICES AG 2.250% 16/10/2026 EMTN | EUR | 188.490,50 | 0,19 |
| 622.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.125% 04/04/2024 EMTN | EUR | 741.136,70 | 0,73 |
| 453.000 | VOLKSWAGEN LEASING GMBH 1.625% 15/08/2025 EMTN | EUR | 554.087,00 | 0,55 |
| | | | **3.190.772,23** | **3,15** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 250.000 | CADENT FINANCE PLC 2.750% 22/09/2046 EMTN | GBP | 340.332,32 | 0,34 |
| 700.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 07/09/2028 FRN EMTN | EUR | 838.122,68 | 0,83 |
| 185.000 | SANTANDER UK GROUP HOLDINGS PLC 1.125% 08/09/2023 | EUR | 219.874,56 | 0,22 |
| 120.000 | SMITHS GROUP PLC 2.000% 23/02/2027 EMTN | EUR | 150.551,64 | 0,15 |
| 400.000 | STANDARD CHARTERED PLC 21/05/2025 FRN | USD | 426.381,22 | 0,42 |
| 700.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 0.875% 29/05/2026 EMTN | EUR | 834.087,31 | 0,82 |
| 141.000 | TESCO CORPORATE TREASURY SERVICES PLC 2.750% 27/04/2030 EMTN | GBP | 199.497,05 | 0,20 |
| | | | **3.008.846,78** | **2,98** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Investment Grade Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Kanada** | | | |
| 1.000.000 | BROOKFIELD FINANCE INC 4.250% 02/06/2026 | USD | 1.118.236,62 | 1,11 |
| 1.500.000 | TECK RESOURCES LTD 3.900% 15/07/2030 | USD | 1.629.133,70 | 1,61 |
| | | | **2.747.370,32** | **2,72** |
| | **Japan** | | | |
| 400.000 | ASAHI MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 407.825,66 | 0,40 |
| 300.000 | FUKOKU MUTUAL LIFE INSURANCE CO FRN PERP | USD | 330.715,79 | 0,33 |
| 305.000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 2.564% 13/09/2031 | USD | 300.150,57 | 0,30 |
| 600.000 | NIPPON LIFE INSURANCE CO 16/09/2051 FRN | USD | 591.423,58 | 0,58 |
| 250.000 | NIPPON LIFE INSURANCE 21/01/2051 FRN | USD | 244.824,59 | 0,24 |
| 450.000 | SUMITOMO LIFE INSURANCE CO 15/04/2081 FRN | USD | 467.594,50 | 0,46 |
| | | | **2.342.534,69** | **2,31** |
| | **Schweiz** | | | |
| 1.500.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG 14/01/2028 FRN EMTN | EUR | 1.738.601,86 | 1,72 |
| | | | **1.738.601,86** | **1,72** |
| | **Italien** | | | |
| 900.000 | ENI SPA 4.250% 09/05/2029 | USD | 1.023.580,01 | 1,01 |
| 450.000 | INTESA SANPAOLO SPA 4.000% 23/09/2029 | USD | 491.688,43 | 0,49 |
| | | | **1.515.268,44** | **1,50** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 320.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.750% 12/09/2025 EMTN | EUR | 392.837,41 | 0,39 |
| 680.000 | CNH INDUSTRIAL FINANCE EUROPE SA 1.875% 19/01/2026 EMTN | EUR | 840.519,13 | 0,83 |
| 200.000 | HEIDELBERGCEMENT FINANCE LUXEMBOURG SA 1.750% 24/04/2028 EMTN | EUR | 251.138,45 | 0,25 |
| | | | **1.484.494,99** | **1,47** |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 200.000 | CLP POWER HK FINANCE LTD FRN PERP | USD | 208.477,87 | 0,21 |
| 400.000 | DIANJIAN HAIYU LTD FRN PERP EMTN | USD | 403.968,64 | 0,40 |
| 205.000 | DIANJIAN INTERNATIONAL FINANCE LTD FRN PERP | USD | 212.173,76 | 0,21 |
| 300.000 | ELECT GLOBAL INVESTMENTS LTD FRN PERP | USD | 305.276,45 | 0,30 |
| 200.000 | OCEAN LAUREL CO LTD 2.375% 20/10/2025 | USD | 197.470,28 | 0,20 |
| | | | **1.327.367,00** | **1,32** |
| | **China** | | | |
| 800.000 | CHINA CONSTRUCTION BANK CORP 24/06/2030 FRN | USD | 812.212,65 | 0,80 |
| 500.000 | CHINA DEVELOPMENT BANK FINANCIAL LEASING CO LTD 28/09/2030 FRN | USD | 507.320,24 | 0,50 |
| | | | **1.319.532,89** | **1,30** |
| | **Dänemark** | | | |
| 1.000.000 | CARLSBERG BREWERIES AS 0.875% 01/07/2029 EMTN | EUR | 1.196.424,62 | 1,18 |
| | | | **1.196.424,62** | **1,18** |
| | **Spanien** | | | |
| 400.000 | ABERTIS INFRAESTRUCTURAS SA 1.875% 26/03/2032 | EUR | 493.991,80 | 0,49 |
| 500.000 | CAIXABANK SA 17/04/2030 FRN EMTN | EUR | 610.248,40 | 0,60 |
| | | | **1.104.240,20** | **1,09** |
| | **Hongkong** | | | |
| 1.050.000 | WEICHAI INTERNATIONAL HONG KONG ENERGY GROUP CO LTD FRN PERP | USD | 1.069.223,91 | 1,06 |
| | | | **1.069.223,91** | **1,06** |
| | **Belgien** | | | |
| 600.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV 2.750% 17/03/2036 EMTN | EUR | 831.700,40 | 0,82 |
| | | | **831.700,40** | **0,82** |
| | **Portugal** | | | |
| 600.000 | BRISA-CONCESSAO RODOVIARIA SA 2.375% 10/05/2027 EMTN | EUR | 777.001,63 | 0,77 |
| | | | **777.001,63** | **0,77** |
| | **Südkorea** | | | |
| 500.000 | HEUNGKUK LIFE INSURANCE CO LTD FRN PERP | USD | 507.497,20 | 0,50 |
| | | | **507.497,20** | **0,50** |
| | **Irland** | | | |
| 250.000 | ZURICH FINANCE IRELAND DESIGNATED ACTIVITY CO 17/09/2050 FRN EMTN | EUR | 304.656,50 | 0,30 |
| | | | **304.656,50** | **0,30** |
| | **Bermuda** | | | |
| 200.000 | STAR ENERGY GEOTHERMAL DARAJAT II / STAR ENERGY GEOTHERMAL SALAK 4.850% 14/10/2038 | USD | 223.943,96 | 0,22 |
| | | | **223.943,96** | **0,22** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 200.000 | AAC TECHNOLOGIES HOLDINGS INC 2.625% 02/06/2026 | USD | 200.010,20 | 0,20 |
| | | | **200.010,20** | **0,20** |
| | **Schweden** | | | |
| 145.000 | FASTIGHETS AB BALDER 1.875% 14/03/2025 | EUR | 176.745,92 | 0,17 |
| | | | **176.745,92** | **0,17** |
| | | | **97.454.993,96** | **96,31** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **97.454.993,96** | **96,31** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 1.781.512,47 | USD | 1.521.000,00 | EUR | 31/12/2021 | 1.781.512,47 | 15.121,97 |
| 12.408,88 | USD | 1.381.203,00 | JPY | 30/12/2021 | 12.408,88 | 17,72 |
| 96.118.000,00 | JPY | 863.429,51 | USD | 30/12/2021 | 863.429,51 | (1.127,83) |
| 480.000,00 | AUD | 348.565,54 | USD | 31/12/2021 | 348.565,54 | (1.661,51) |
| 342.000,00 | CHF | 369.776,26 | USD | 31/12/2021 | 369.776,26 | (2.256,81) |
| 3.987.000,00 | CAD | 3.151.132,74 | USD | 31/12/2021 | 3.151.132,74 | (3.743,03) |
| 3.046.000,00 | GBP | 4.145.306,27 | USD | 31/12/2021 | 4.145.306,27 | (37.173,08) |
| | | | | | **10.672.131,67** | **(30.822,57)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Investment Grade Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| 20 | CANADA 10YR BOND FUTURE 20/12/2021 | CAD | 2.259.936,06 | (53.202,83) |
| (18) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 2.814.788,18 | 18.357,78 |
| (1) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 196.812,89 | 3.140,75 |
| (3) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 706.982,67 | 22.529,99 |
| 9 | EURO-SCHATZ FUTURE 08/12/2021 | EUR | 1.170.359,84 | (886,60) |
| 1 | JAPAN 10Y BOND (OSE) 13/12/2021 | JPY | 1.356.665,92 | (5.825,68) |
| 23 | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 3.881.157,92 | (120.946,99) |
| 9 | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 1.432.968,75 | (38.390,63) |
| 42 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 8.024.625,00 | (279.687,50) |
| (224) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 29.480.500,00 | 413.156,25 |
| (3) | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 435.750,00 | 8.578,13 |
| 12 | US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 2.640.656,26 | (1.406,24) |
| 50 | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 6.137.109,40 | (39.453,10) |
| | | | **60.538.312,89** | **(74.036,67)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(104.859,24)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **97.454.993,96** | **96,31** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(104.859,24)** | **(0,10)** |
| **Bankguthaben** | **2.606.980,16** | **2,58** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **1.234.098,71** | **1,21** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **101.191.213,59** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 170.480.372,51 |
| | 30.09.2020 | EUR | 321.435.331,84 |
| | 30.09.2019 | EUR | 450.184.658,82 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 9.365,57 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.398,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 9.505,60 |
| Capitalisation I (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 178,44 |
| | 30.09.2020 | GBP | 148,77 |
| | 30.09.2019 | GBP | 186,41 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 7.043,58 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.630,32 |
| | 30.09.2019 | USD | 6.724,68 |
| Capitalisation M (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 406,11 |
| | 30.09.2020 | EUR | 322,78 |
| | 30.09.2019 | EUR | 417,23 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 401,06 |
| | 30.09.2020 | EUR | 319,74 |
| | 30.09.2019 | EUR | 414,51 |
| Capitalisation P (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 157,49 |
| | 30.09.2020 | GBP | 133,06 |
| | 30.09.2019 | GBP | 168,09 |
| Capitalisation P (SGD) | 30.09.2021 | SGD | 17,38 |
| | 30.09.2020 | SGD | 14,09 |
| | 30.09.2019 | SGD | 17,21 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 467,97 |
| | 30.09.2020 | USD | 377,49 |
| | 30.09.2019 | USD | 454,99 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 306,30 |
| | 30.09.2020 | EUR | 242,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 312,49 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 292,37 |
| | 30.09.2020 | USD | 234,32 |
| | 30.09.2019 | USD | 280,59 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.493,37 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.196,51 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.558,97 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.761,31 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.520,78 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.768,27 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 265,07 |
| | 30.09.2020 | EUR | 219,60 |
| | 30.09.2019 | EUR | 296,80 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 27,05 |
| | 30.09.2020 | EUR | 22,29 |
| | 30.09.2019 | EUR | 29,93 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 2.124 |
| | 30.09.2020 | | 2.128 |
| | 30.09.2019 | | 3.760 |
| Capitalisation I (GBP) | 30.09.2021 | | 264 |
| | 30.09.2020 | | 264 |
| | 30.09.2019 | | 264 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 1.444 |
| | 30.09.2020 | | 393 |
| | 30.09.2019 | | 1.127 |
| Capitalisation M (EUR) | 30.09.2021 | | 68.807 |
| | 30.09.2020 | | 838.352 |
| | 30.09.2019 | | 707.375 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 11.537 |
| | 30.09.2020 | | 15.179 |
| | 30.09.2019 | | 22.849 |
| Capitalisation P (GBP) | 30.09.2021 | | 29 |
| | 30.09.2020 | | 275 |
| | 30.09.2019 | | 6.105 |
| Capitalisation P (SGD) | 30.09.2021 | | 72.983 |
| | 30.09.2020 | | 71.529 |
| | 30.09.2019 | | 70.020 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 3.491 |
| | 30.09.2020 | | 3.749 |
| | 30.09.2019 | | 4.691 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 4.383 |
| | 30.09.2020 | | 6.263 |
| | 30.09.2019 | | 6.827 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | | 766 |
| | 30.09.2020 | | 807 |
| | 30.09.2019 | | 807 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 948 |
| | 30.09.2020 | | 1.213 |
| | 30.09.2019 | | 1.767 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | | 17.490 |
| | 30.09.2020 | | 4.516 |
| | 30.09.2019 | | 15.176 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | | 1.707 |
| | 30.09.2020 | | 1.877 |
| | 30.09.2019 | | 8.322 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 103.398 |
| | 30.09.2020 | 110.653 |
| | 30.09.2019 | 127.005 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 8,80 |
| Distribution R (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,90 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation I (GBP) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation M (EUR) | 30.09.2021 | 1,29% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation P (GBP) | 30.09.2021 | 1,55% |
| Capitalisation P (SGD) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,10% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 0,01% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,59% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 162,61% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **168.368.574,66** |
| Aktien | | 168.368.574,66 |
| **Bankguthaben** | | **1.513.346,73** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **694.803,46** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***170.576.724,85*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(96.352,34)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(96.352,34)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***170.480.372,51*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **7.035.358,44** |
| Dividenden | | 7.035.358,44 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.309.703,04)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (1.052.606,10) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (220.394,64) |
| Abonnementsteuer | 9 | (21.028,76) |
| Bankzinsen | | (15.673,54) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **5.725.655,40** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 41.516.965,15 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (25.050.479,50) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 2.912.307,02 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (3.259.875,03) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 23.553.140,14 |
| **Ergebnis** | | **45.397.713,18** |
| Zeichnungen | | 155.694.404,54 |
| Rücknahmen | | (351.931.589,19) |
| Ausschüttung | | (115.487,86) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 321.435.331,84 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***170.480.372,51*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

#### Vereinigte Staaten

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 52.669 | AGREE REALTY CORP | USD | 3.009.851,91 | 1,77 |
| 1.292 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 295.879,65 | 0,17 |
| 29.900 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 5.718.137,97 | 3,35 |
| 25.077 | BOSTON PROPERTIES INC | USD | 2.344.443,63 | 1,38 |
| 196.400 | BRANDYWINE REALTY TRUST | USD | 2.274.203,37 | 1,32 |
| 48.487 | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | USD | 925.016,24 | 0,54 |
| 4.009 | CBRE GROUP INC - A | USD | 336.784,37 | 0,20 |
| 600 | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | USD | 89.729,50 | 0,05 |
| 109.247 | CUBESMART | USD | 4.567.079,81 | 2,68 |
| 24.451 | DIGITAL REALTY TRUST INC | USD | 3.047.540,40 | 1,79 |
| 40.743 | DUKE REALTY CORP | USD | 1.682.874,51 | 0,99 |
| 145 | EQUINIX INC | USD | 98.855,73 | 0,06 |
| 40.424 | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | USD | 2.724.116,14 | 1,60 |
| 83.300 | EQUITY RESIDENTIAL | USD | 5.816.157,73 | 3,41 |
| 11.182 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | USD | 3.084.975,78 | 1,81 |
| 10.675 | EXTRA SPACE STORAGE INC | USD | 1.547.343,07 | 0,91 |
| 51.300 | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | USD | 5.222.733,51 | 3,06 |
| 55.013 | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | USD | 2.198.716,22 | 1,29 |
| 194.895 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | USD | 5.630.169,20 | 3,30 |
| 13.464 | HIGHWOODS PROPERTIES INC | USD | 509.539,70 | 0,30 |
| 6.000 | HOST HOTELS & RESORTS INC | USD | 84.542,04 | 0,05 |
| 1.000 | HOWARD HUGHES CORP/THE | USD | 75.766,86 | 0,04 |
| 100.000 | HUDSON PACIFIC PROPERTIES INC | USD | 2.266.706,93 | 1,33 |
| 190.834 | INVITATION HOMES INC | USD | 6.311.460,56 | 3,70 |
| 2.600 | IRON MOUNTAIN INC | USD | 97.476,16 | 0,06 |
| 26.700 | KILROY REALTY CORP | USD | 1.525.352,26 | 0,89 |
| 995 | LAMAR ADVERTISING CO - A | USD | 97.400,88 | 0,06 |
| 33.101 | LIFE STORAGE INC | USD | 3.277.111,82 | 1,92 |
| 384 | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | USD | 61.876,70 | 0,04 |
| 22.336 | NATIONAL HEALTH INVESTORS INC | USD | 1.031.085,03 | 0,60 |
| 132.586 | PROLOGIS INC | USD | 14.349.421,44 | 8,42 |
| 4.200 | PUBLIC STORAGE | USD | 1.076.681,48 | 0,63 |
| 28.190 | REALTY INCOME CORP | USD | 1.577.637,86 | 0,93 |
| 18.100 | REGENCY CENTERS CORP | USD | 1.051.531,99 | 0,62 |
| 7.800 | RLJ LODGING TRUST | USD | 100.011,22 | 0,06 |
| 1.099 | SBA COMMUNICATIONS CORP - A | USD | 313.470,32 | 0,18 |
| 18.100 | SIMON PROPERTY GROUP INC | USD | 2.029.817,51 | 1,19 |
| 11.100 | SL GREEN REALTY CORP | USD | 678.479,66 | 0,40 |
| 14.000 | SPIRIT REALTY CAPITAL INC | USD | 556.158,59 | 0,33 |
| 119.278 | VENTAS INC | USD | 5.682.159,18 | 3,33 |
| 11.000 | VICI PROPERTIES INC | USD | 269.649,25 | 0,16 |
| 2.000 | VORNADO REALTY TRUST | USD | 72.496,66 | 0,04 |
| 34.800 | WELLTOWER INC | USD | 2.474.239,61 | 1,45 |
| 46.581 | WP CAREY INC | USD | 2.935.654,03 | 1,72 |
| | | | **99.120.336,48** | **58,13** |

#### Japan

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 32.200 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD | JPY | 928.292,65 | 0,54 |
| 2.968 | GLP J-REIT | JPY | 4.192.402,20 | 2,46 |
| 1.201 | JAPAN METROPOLITAN FUND INVEST | JPY | 993.610,80 | 0,58 |
| 172 | JAPAN REAL ESTATE INVESTMENT CORP | JPY | 885.887,32 | 0,52 |
| 238 | KENEDIX OFFICE INVESTMENT CORP - A | JPY | 1.407.491,87 | 0,83 |
| 362.000 | MITSUBISHI ESTATE CO LTD | JPY | 4.969.630,77 | 2,92 |
| 237.400 | MITSUI FUDOSAN CO LTD | JPY | 4.882.685,11 | 2,86 |
| 394 | MORI HILLS REIT INVESTMENT CORP - A | JPY | 458.719,01 | 0,27 |
| 14.400 | NOMURA REAL ESTATE HOLDINGS INC | JPY | 323.982,35 | 0,19 |
| 902 | NOMURA REAL ESTATE MASTER FUND INC | JPY | 1.116.929,22 | 0,66 |
| 45 | ORIX JREIT INC | JPY | 67.311,28 | 0,04 |
| 665 | SEKISUI HOUSE REIT INC | JPY | 473.769,60 | 0,28 |
| 10.400 | TOKYU FUDOSAN HOLDINGS CORP | JPY | 55.329,41 | 0,03 |
| | | | **20.756.041,59** | **12,18** |

#### Deutschland

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 16.223 | LEG IMMOBILIEN SE | EUR | 1.982.450,60 | 1,16 |
| 141.854 | VONOVIA SE | EUR | 7.362.222,60 | 4,32 |
| | | | **9.344.673,20** | **5,48** |

#### Vereinigtes Königreich

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 6.100 | BIG YELLOW GROUP PLC | GBP | 99.001,54 | 0,06 |
| 559.921 | LONDONMETRIC PROPERTY PLC | GBP | 1.558.209,49 | 0,91 |
| 85.043 | SAFESTORE HOLDINGS PLC | GBP | 1.037.891,55 | 0,61 |
| 1.518.053 | TRITAX BIG BOX REIT PLC | GBP | 3.754.811,24 | 2,19 |
| 88.500 | UNITE GROUP PLC | GBP | 1.120.237,43 | 0,66 |
| | | | **7.570.151,25** | **4,43** |

#### Singapur

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1.780.600 | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | SGD | 2.290.504,28 | 1,34 |
| 1.126.700 | MAPLETREE COMMERCIAL TRUST | SGD | 1.477.907,85 | 0,87 |
| 2.591.500 | SUNTEC REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | SGD | 2.331.891,27 | 1,37 |
| | | | **6.100.303,40** | **3,58** |

#### Australien

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 659.100 | CHARTER HALL LONG WALE REIT | AUD | 2.023.328,59 | 1,19 |
| 546.977 | DEXUS | AUD | 3.670.970,79 | 2,15 |
| 46.200 | GPT GROUP/THE | AUD | 145.558,67 | 0,09 |
| | | | **5.839.858,05** | **3,43** |

#### Hongkong

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 438.000 | HANG LUNG PROPERTIES LTD | HKD | 859.643,62 | 0,50 |
| 257.700 | LINK REIT | HKD | 1.900.934,14 | 1,12 |
| 478.762 | SINO LAND CO LTD | HKD | 554.475,47 | 0,33 |
| 870.400 | SWIRE PROPERTIES LTD | HKD | 1.877.587,05 | 1,10 |
| | | | **5.192.640,28** | **3,05** |

#### Kanada

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 116.200 | FIRST CAPITAL REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | CAD | 1.385.014,35 | 0,81 |
| 36.400 | H&R REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | CAD | 387.498,89 | 0,23 |
| 108.400 | KILLAM APARTMENT REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | CAD | 1.568.911,02 | 0,92 |
| 23.100 | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | CAD | 340.470,38 | 0,20 |
| 21.600 | SUMMIT INDUSTRIAL INCOME REIT | CAD | 306.592,53 | 0,18 |
| | | | **3.988.487,17** | **2,34** |

#### Schweden

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 112.684 | CASTELLUM AB | SEK | 2.383.904,00 | 1,40 |
| 19.100 | FABEGE AB | SEK | 249.602,23 | 0,15 |
| 90.300 | SAMHALLSBYGGNADSBOLAGET I NORDEN AB | SEK | 431.767,13 | 0,25 |
| | | | **3.065.273,36** | **1,80** |

#### Frankreich

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 16.500 | COVIVIO | EUR | 1.201.530,00 | 0,70 |
| 2.900 | GECINA SA | EUR | 337.995,00 | 0,20 |
| 16.500 | ICADE | EUR | 1.119.525,00 | 0,66 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Real Estate

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 16.200 | MERCIALYS SA | EUR | 149.202,00 | 0,09 |
| | | | **2.808.252,00** | **1,65** |
| | **Belgien** | | | |
| 20.744 | COFINIMMO SA | EUR | 2.717.464,00 | 1,59 |
| | | | **2.717.464,00** | **1,59** |
| | **Schweiz** | | | |
| 2.943 | PSP SWISS PROPERTY AG - REG | CHF | 306.515,28 | 0,18 |
| 17.473 | SWISS PRIME SITE AG - REG | CHF | 1.477.192,68 | 0,87 |
| | | | **1.783.707,96** | **1,05** |
| | **Finnland** | | | |
| 11.744 | CITYCON OYJ | EUR | 81.385,92 | 0,05 |
| | | | **81.385,92** | **0,05** |
| | | | **168.368.574,66** | **98,76** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **168.368.574,66** | **98,76** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **168.368.574,66** | **98,76** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **0,00** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **1.513.346,73** | **0,89** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **598.451,12** | **0,35** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **170.480.372,51** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 2.359.878.861,35 |
| | 30.09.2020 | EUR | 2.331.142.699,74 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.894.331.442,78 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 675,73 |
| | 30.09.2020 | EUR | 514,58 |
| | 30.09.2019 | EUR | 412,36 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 8.585,45 |
| | 30.09.2020 | USD | 6.615,43 |
| | 30.09.2019 | USD | 4.928,32 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 8.866,95 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.893,35 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.332,87 |
| Capitalisation M (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 597,01 |
| | 30.09.2020 | EUR | 456,80 |
| | 30.09.2019 | EUR | 367,82 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 71,53 |
| | 30.09.2020 | EUR | 54,43 |
| | 30.09.2019 | EUR | 43,58 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 71,53 |
| | 30.09.2020 | EUR | 54,43 |
| | 30.09.2019 | EUR | 43,58 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 585,63 |
| | 30.09.2020 | EUR | 450,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | 364,53 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 111,37 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 467,16 |
| | 30.09.2020 | EUR | 356,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 286,48 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 425,20 |
| | 30.09.2020 | USD | 328,47 |
| | 30.09.2019 | USD | 245,24 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 500,85 |
| | 30.09.2020 | EUR | 384,85 |
| | 30.09.2019 | EUR | 311,18 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 528,93 |
| | 30.09.2020 | EUR | 408,85 |
| | 30.09.2019 | EUR | 332,55 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 400,53 |
| | 30.09.2020 | USD | 313,28 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 27.256,86 |
| | 30.09.2020 | CZK | 20.982,80 |
| | 30.09.2019 | CZK | 17.105,04 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 19.575,40 |
| | 30.09.2020 | EUR | 14.817,97 |
| | 30.09.2019 | EUR | 11.803,39 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 11.664,54 |
| | 30.09.2020 | EUR | 8.811,50 |
| | 30.09.2019 | EUR | 7.003,58 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 2.028,79 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.560,37 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.263,27 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 39,99 |
| | 30.09.2020 | EUR | 30,53 |
| | 30.09.2019 | EUR | 24,57 |
| Distribution T (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 40,33 |
| | 30.09.2020 | EUR | 30,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 24,65 |

| **Anzahl der Anteile** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 1.038.727 |
| | 30.09.2020 | 1.674.206 |
| | 30.09.2019 | 1.459.098 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 2.644 |
| | 30.09.2020 | 1.677 |
| | 30.09.2019 | 2 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 4.633 |
| | 30.09.2020 | 6.105 |
| | 30.09.2019 | 6.900 |
| Capitalisation M (EUR) | 30.09.2021 | 101.584 |
| | 30.09.2020 | 385.490 |
| | 30.09.2019 | 382.262 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 10.800.224 |
| | 30.09.2020 | 13.479.989 |
| | 30.09.2019 | 13.324.849 |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 248.141 |
| | 30.09.2020 | 283.547 |
| | 30.09.2019 | 351.976 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 567.277 |
| | 30.09.2020 | 361.893 |
| | 30.09.2019 | 309.330 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 14.507 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 83.703 |
| | 30.09.2020 | 74.212 |
| | 30.09.2019 | 22.612 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 11.067 |
| | 30.09.2020 | 399 |
| | 30.09.2019 | 1.394 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 2.940 |
| | 30.09.2020 | 6.397 |
| | 30.09.2019 | 16.045 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 74.890 |
| | 30.09.2020 | 44.107 |
| | 30.09.2019 | 30.249 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 63.328 |
| | 30.09.2020 | 14.168 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 29.961 |
| | 30.09.2020 | 28.784 |
| | 30.09.2019 | 26.267 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 8.190 |
| | 30.09.2020 | 10.305 |
| | 30.09.2019 | 10.449 |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 733 |
| | 30.09.2020 | 3.299 |
| | 30.09.2019 | 26.342 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 30.927 |
| | 30.09.2020 | 24.938 |
| | 30.09.2019 | 21.345 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 964.026 |
| | 30.09.2020 | 1.049.256 |
| | 30.09.2019 | 1.173.286 |
| Distribution T (EUR) | 30.09.2021 | 105.230 |
| | 30.09.2020 | 130.303 |
| | 30.09.2019 | 145.274 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation M (EUR) | 30.09.2021 | 1,29% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,73% |
| Capitalisation O (EUR) | 30.09.2021 | 0,73% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 1,71% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,21% |
| Capitalisation Zz (EUR) | 30.09.2021 | 0,01% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution T (EUR) | 30.09.2021 | 0,70% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 8,42% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Global Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **2.353.024.019,24** |
| Aktien | | 2.353.024.019,24 |
| **Bankguthaben** | | **10.025.036,66** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **26.025.239,08** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***2.389.074.294,98*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(13.355.245,27)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(15.241.247,37)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(598.940,99)** |
| Devisentermingeschäfte | | (598.940,99) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(29.195.433,63)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***2.359.878.861,35*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **15.976.145,79** |
| Dividenden | | 15.976.145,79 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(20.861.164,37)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (15.003.194,29) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (4.941.495,97) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (15.030,98) |
| Abonnementsteuer | 9 | (713.403,63) |
| Bankzinsen | | (188.039,50) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(4.885.018,58)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 448.468.990,22 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (37.897.265,08) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 349.706,29 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (16.622,14) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 6.324.879,04 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (6.062.708,87) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 172.000.544,28 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 715.128,99 |
| **Ergebnis** | | **578.997.634,15** |
| Zeichnungen | | 543.162.962,10 |
| Rücknahmen | | (1.093.424.434,64) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 2.331.142.699,74 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***2.359.878.861,35*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 149.942 | ADOBE INC | USD | 74.485.187,66 | 3,16 |
| 38.869 | ALPHABET INC - A | USD | 89.664.824,95 | 3,80 |
| 8.062 | ALPHABET INC - C | USD | 18.540.687,02 | 0,79 |
| 146.177 | ANTHEM INC | USD | 47.020.825,40 | 1,99 |
| 361.683 | APPLE INC | USD | 44.159.061,65 | 1,87 |
| 1.023.886 | BROWN & BROWN INC | USD | 48.987.858,58 | 2,08 |
| 951.738 | COMCAST CORP - A | USD | 45.930.114,62 | 1,95 |
| 161.179 | ESTEE LAUDER COS INC/THE - A | USD | 41.712.254,60 | 1,77 |
| 300.191 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 21.177.459,04 | 0,90 |
| 140.169 | FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | USD | 31.599.253,32 | 1,34 |
| 84.481 | ILLUMINA INC | USD | 29.566.709,88 | 1,25 |
| 168.531 | INTUIT INC | USD | 78.453.910,70 | 3,32 |
| 276.616 | MATCH GROUP INC | USD | 37.470.077,09 | 1,59 |
| 250.115 | MCCORMICK & CO INC/MD - NON VOTING | USD | 17.487.224,17 | 0,74 |
| 604.048 | MICROSOFT CORP | USD | 146.937.497,01 | 6,23 |
| 86.361 | MOODY'S CORP | USD | 26.461.585,67 | 1,12 |
| 325.959 | NASDAQ INC | USD | 54.287.593,24 | 2,30 |
| 74.189 | NETFLIX INC | USD | 39.070.291,44 | 1,66 |
| 401.852 | NIKE INC - B | USD | 50.356.759,10 | 2,13 |
| 144.369 | NORDSON CORP | USD | 29.666.057,51 | 1,26 |
| 247.251 | NORTHERN TRUST CORP | USD | 23.000.241,87 | 0,97 |
| 207.862 | NVIDIA CORP | USD | 37.154.917,74 | 1,57 |
| 162.468 | SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | USD | 37.180.001,69 | 1,58 |
| 159.163 | S&P GLOBAL INC | USD | 58.351.755,53 | 2,47 |
| 110.734 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 54.588.771,06 | 2,31 |
| 171.610 | ULTA BEAUTY INC | USD | 53.442.755,25 | 2,26 |
| 220.055 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 74.191.544,67 | 3,14 |
| 82.879 | VEEVA SYSTEMS INC - A | USD | 20.607.654,71 | 0,87 |
| 284.243 | VISA INC - A | USD | 54.631.458,00 | 2,32 |
| 219.542 | ZOETIS INC - A | USD | 36.776.292,23 | 1,56 |
| | | | **1.422.960.625,40** | **60,30** |
| **Schweiz** | | | | |
| 325.791 | CHUBB LTD | USD | 48.766.748,07 | 2,07 |
| 600.702 | NESTLE SA - REG | CHF | 62.619.049,22 | 2,65 |
| 49.821 | PARTNERS GROUP HOLDING AG | CHF | 67.579.968,18 | 2,86 |
| | | | **178.965.765,47** | **7,58** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 1.229.570 | COMPASS GROUP PLC | GBP | 21.800.986,18 | 0,92 |
| 1.183.625 | RELX PLC | EUR | 29.590.625,00 | 1,25 |
| 466.805 | UNILEVER PLC | EUR | 21.774.119,23 | 0,92 |
| 3.724.477 | 3I GROUP PLC | GBP | 55.529.251,77 | 2,36 |
| | | | **128.694.982,18** | **5,45** |
| **Niederlande** | | | | |
| 21.897 | ADYEN NV | EUR | 52.881.255,00 | 2,24 |
| 79.370 | ASML HOLDING NV | EUR | 51.265.083,00 | 2,17 |
| | | | **104.146.338,00** | **4,41** |
| **Irland** | | | | |
| 171.630 | ICON PLC - ADR | USD | 38.802.789,25 | 1,64 |
| 138.800 | LINDE PLC | EUR | 35.546.680,00 | 1,51 |
| | | | **74.349.469,25** | **3,15** |
| **Schweden** | | | | |
| 1.106.536 | ATLAS COPCO AB - A | SEK | 58.081.741,38 | 2,46 |
| | | | **58.081.741,38** | **2,46** |
| **Jersey** | | | | |
| 432.819 | APTIV PLC | USD | 55.634.019,09 | 2,36 |
| | | | **55.634.019,09** | **2,36** |
| **Färöer-Inseln** | | | | |
| 777.080 | BAKKAFROST P/F | NOK | 55.611.248,84 | 2,36 |
| | | | **55.611.248,84** | **2,36** |
| **Dänemark** | | | | |
| 465.516 | NOVO NORDISK AS - B | DKK | 38.901.829,73 | 1,65 |
| 258.549 | NOVOZYMES AS - B | DKK | 15.298.882,39 | 0,65 |
| | | | **54.200.712,12** | **2,30** |
| **Japan** | | | | |
| 869.400 | RECRUIT HOLDINGS CO LTD | JPY | 45.797.425,80 | 1,94 |
| | | | **45.797.425,80** | **1,94** |
| **Hongkong** | | | | |
| 4.274.400 | AIA GROUP LTD | HKD | 42.489.117,77 | 1,80 |
| | | | **42.489.117,77** | **1,80** |
| **Deutschland** | | | | |
| 489.013 | HELLOFRESH SE | EUR | 39.101.479,48 | 1,66 |
| | | | **39.101.479,48** | **1,66** |
| **Spanien** | | | | |
| 1.387.284 | SIEMENS GAMESA RENEWABLE ENERGY SA | EUR | 30.547.993,68 | 1,29 |
| | | | **30.547.993,68** | **1,29** |
| **Finnland** | | | | |
| 571.935 | NESTE OYJ | EUR | 28.007.656,95 | 1,19 |
| | | | **28.007.656,95** | **1,19** |
| **Frankreich** | | | | |
| 143.209 | SCHNEIDER ELECTRIC SE | EUR | 20.607.775,10 | 0,87 |
| | | | **20.607.775,10** | **0,87** |
| **Norwegen** | | | | |
| 305.907 | TOMRA SYSTEMS ASA | NOK | 13.827.668,73 | 0,59 |
| | | | **13.827.668,73** | **0,59** |
| | | | **2.353.024.019,24** | **99,71** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **2.353.024.019,24** | **99,71** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Global Sustainable Equity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 897.923.490,31 | CZK | 35.329.779,37 | EUR | 19/10/2021 | 35.329.779,37 | 71.584,70 |
| 847.712,69 | HKD | 92.644,50 | EUR | 19/10/2021 | 92.644,50 | 1.292,78 |
| 1.403.942,77 | EUR | 1.206.020,53 | GBP | 19/10/2021 | 1.403.942,77 | 1.218,17 |
| 1.267.343,58 | SEK | 124.506,20 | EUR | 19/10/2021 | 124.506,20 | 466,11 |
| 1.058.073,56 | EUR | 7.865.214,12 | DKK | 19/10/2021 | 1.058.073,56 | 365,54 |
| 149.650,86 | CHF | 138.222,61 | EUR | 19/10/2021 | 138.222,61 | 211,23 |
| 649.719,62 | NOK | 64.143,69 | EUR | 19/10/2021 | 64.143,69 | 52,06 |
| 442.122,93 | DKK | 59.451,59 | EUR | 19/10/2021 | 59.451,59 | 4,77 |
| 127,98 | EUR | 206,23 | AUD | 19/10/2021 | 127,98 | (0,53) |
| 1.652,45 | EUR | 42.156,42 | CZK | 01/10/2021 | 1.652,45 | (10,98) |
| 60.045,12 | GBP | 70.171,17 | EUR | 19/10/2021 | 70.171,17 | (332,59) |
| 133.156,77 | EUR | 3.395.297,78 | CZK | 04/10/2021 | 133.156,77 | (817,06) |
| 2.387.680,82 | EUR | 2.586.538,82 | CHF | 19/10/2021 | 2.387.680,82 | (4.985,07) |
| 838.878,89 | EUR | 109.327.257,00 | JPY | 19/10/2021 | 838.878,89 | (6.427,98) |
| 1.144.782,79 | EUR | 11.679.587,99 | SEK | 19/10/2021 | 1.144.782,79 | (6.937,33) |
| 2.796.285,86 | EUR | 71.194.125,84 | CZK | 19/10/2021 | 2.796.285,86 | (10.600,47) |
| 820.929,28 | EUR | 7.556.248,15 | HKD | 19/10/2021 | 820.929,28 | (16.398,55) |
| 1.306.635,05 | EUR | 13.421.994,38 | NOK | 19/10/2021 | 1.306.635,05 | (19.529,34) |
| 27.816.807,45 | EUR | 32.952.763,69 | USD | 19/10/2021 | 27.816.807,45 | (608.096,45) |
| | | | | | **75.587.872,80** | **(598.940,99)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(598.940,99)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **2.353.024.019,24** | **99,71** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(598.940,99)** | **(0,03)** |
| **Bankguthaben** | **10.025.036,66** | **0,42** |
| **Bankverbindlichkeiten** | **(13.355.245,27)** | **(0,57)** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **10.783.991,71** | **0,47** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **2.359.878.861,35** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Greater China Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 312.444.342,54 |
| | 30.09.2020 | USD | 190.355.528,88 |
| | 30.09.2019 | USD | 150.815.072,21 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 11.588,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | 10.189,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 8.058,63 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 21.597,41 |
| | 30.09.2020 | USD | 19.215,35 |
| | 30.09.2019 | USD | 14.128,30 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.028,83 |
| | 30.09.2020 | EUR | 906,38 |
| | 30.09.2019 | EUR | 718,20 |
| Capitalisation O (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.907,96 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.697,29 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.247,82 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 962,66 |
| | 30.09.2020 | EUR | 855,29 |
| | 30.09.2019 | EUR | 683,46 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.836,02 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.650,58 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.226,28 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 355,62 |
| | 30.09.2020 | USD | 317,32 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 167.961,19 |
| | 30.09.2020 | HUF | 151.643,58 |
| | 30.09.2019 | HUF | 112.334,87 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.668,56 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.507,41 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.125,37 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 537,23 |
| | 30.09.2020 | USD | 490,26 |
| | 30.09.2019 | USD | 369,67 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | USD | 4.117,61 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution N (USD) | 30.09.2021 | USD | 7.794,89 |
| | 30.09.2020 | USD | 6.986,76 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.210,56 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 7.795,04 |
| | 30.09.2020 | USD | 7.007,75 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.233,77 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 359,99 |
| | 30.09.2020 | USD | 322,69 |
| | 30.09.2019 | USD | 240,71 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 2.426 |
| | 30.09.2020 | | 1.587 |
| | 30.09.2019 | | 1.388 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 1.947 |
| | 30.09.2020 | | 1.947 |
| | 30.09.2019 | | 1.944 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 10.783 |
| | 30.09.2020 | | 7.865 |
| | 30.09.2019 | | 6.325 |
| Capitalisation O (USD) | 30.09.2021 | | 1.084 |
| | 30.09.2020 | | 1.264 |
| | 30.09.2019 | | 1.410 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 4.160 |
| | 30.09.2020 | | 3.592 |
| | 30.09.2019 | | 3.783 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 51.189 |
| | 30.09.2020 | | 40.879 |
| | 30.09.2019 | | 40.517 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | | 1.123 |
| | 30.09.2020 | | 997 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | | 12.263 |
| | 30.09.2020 | | 5.451 |
| | 30.09.2019 | | 2.124 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | | 33.787 |
| | 30.09.2020 | | 18.778 |
| | 30.09.2019 | | 24.541 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | | 69.538 |
| | 30.09.2020 | | 25.485 |
| | 30.09.2019 | | 42.202 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | | 2.436 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Distribution N (USD) | 30.09.2021 | | 33 |
| | 30.09.2020 | | 27 |
| | 30.09.2019 | | 342 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | | 1.660 |
| | 30.09.2020 | | 1.161 |
| | 30.09.2019 | | 1.127 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Greater China Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 718 |
| | 30.09.2020 | 885 |
| | 30.09.2019 | 1.096 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution N (USD) | 14.12.2020 | USD | 41,45 |
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 1,60 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,86% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,86% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation O (USD) | 30.09.2021 | 0,85% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,90% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,90% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,15% |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 2,40% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,40% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 3,40% |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | 0,26% |
| Distribution N (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,90% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,15% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (30,84%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Greater China Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **308.917.253,59** |
| Aktien | | 308.917.253,59 |
| **Bankguthaben** | | **2.288.319,59** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **9.617.929,78** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***320.823.502,96*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(8.379.160,42)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(8.379.160,42)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***312.444.342,54*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **3.004.534,96** |
| Dividenden | | 2.801.052,50 |
| Sonstige Erträge | 10 | 203.482,46 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(5.731.424,47)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (4.211.392,90) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.373.172,83) |
| Abonnementsteuer | 9 | (128.305,22) |
| Bankzinsen | | (3.642,34) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (14.911,18) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(2.726.889,51)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 65.291.694,49 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (47.344.384,68) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 2.332,61 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (3.394,25) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 999.858,25 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.104.531,18) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (13.697.183,93) |
| **Ergebnis** | | **1.417.501,80** |
| Zeichnungen | | 535.725.265,20 |
| Rücknahmen | | (415.051.625,10) |
| Ausschüttung | | (2.328,24) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 190.355.528,88 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***312.444.342,54*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Greater China Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 247.000 | AIRTAC INTERNATIONAL GROUP | TWD | 7.734.304,69 | 2,48 |
| 79.100 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD ADR | USD | 11.710.755,00 | 3,75 |
| 75.000 | BILIBILI INC - ADR | USD | 4.962.750,00 | 1,59 |
| 12.570.000 | BOSIDENG INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 8.918.895,90 | 2,85 |
| 3.524.000 | CHINASOFT INTERNATIONAL LTD | HKD | 6.210.411,88 | 1,99 |
| 143.900 | JD.COM INC ADR | USD | 10.395.336,00 | 3,33 |
| 292.000 | MEITUAN - B | HKD | 9.222.358,70 | 2,95 |
| 4.608.163 | SHIMAO SERVICES HOLDINGS LTD | HKD | 9.502.104,15 | 3,04 |
| 60.000 | SILERGY CORP | TWD | 8.814.154,98 | 2,82 |
| 3.047.283 | SUNAC SERVICES HOLDINGS LTD | HKD | 6.283.545,19 | 2,01 |
| 356.300 | TENCENT HOLDINGS LTD | HKD | 21.055.206,16 | 6,74 |
| 3.484.800 | TONGCHENG-ELONG HOLDINGS LTD | HKD | 8.399.695,95 | 2,69 |
| 3.820.000 | TOPSPORTS INTERNATIONAL HOLDINGS LTD | HKD | 4.354.311,25 | 1,39 |
| 232.000 | TRIP.COM GROUP LTD ADR | USD | 7.134.000,00 | 2,28 |
| 3.237.000 | WEIMOB INC | HKD | 4.676.466,93 | 1,50 |
| 508.000 | WUXI BIOLOGICS CAYMAN INC | HKD | 8.230.388,30 | 2,63 |
| | | | **137.604.685,08** | **44,04** |
| | **China** | | | |
| 1.050.000 | ANHUI CONCH CEMENT CO LTD - H | HKD | 5.648.129,88 | 1,81 |
| 1.111.077 | BEIJING ORIENTAL YUHONG WATERPROOF TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 7.607.117,45 | 2,43 |
| 650.000 | CHINA MERCHANTS BANK CO LTD - H | HKD | 5.165.605,40 | 1,65 |
| 12.770.000 | CHINA MOLYBDENUM CO LTD - H | HKD | 7.932.293,26 | 2,55 |
| 111.783 | CONTEMPORARY AMPEREX TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 9.078.513,36 | 2,91 |
| 428.000 | EVE ENERGY CO LTD - A | CNH | 6.547.669,73 | 2,10 |
| 2.340.000 | GF SECURITIES CO LTD - H | HKD | 4.069.880,92 | 1,30 |
| 1.970.000 | GREAT WALL MOTOR CO LTD - H | HKD | 7.241.261,10 | 2,32 |
| 442.268 | LONGSHINE TECHNOLOGY GROUP CO LTD - A | CNH | 1.764.078,77 | 0,56 |
| 390.000 | THUNDER SOFTWARE TECHNOLOGY CO LTD - A | CNH | 7.542.415,64 | 2,41 |
| 993.915 | WUXI LEAD INTELLIGENT EQUIPMENT CO LTD - A | CNH | 10.720.259,70 | 3,43 |
| 889.974 | YANTAI JEREH OILFIELD SERVICES GROUP CO LTD - A | CNH | 6.656.996,42 | 2,13 |
| 946.000 | YUNNAN ALUMINIUM CO LTD - A | CNH | 2.167.247,45 | 0,69 |
| 103.238 | YUNNAN ENERGY NEW MATERIAL CO LTD - A | CNH | 4.467.452,22 | 1,43 |
| | | | **86.608.921,30** | **27,72** |
| | **Taiwan** | | | |
| 320.000 | GLOBALWAFERS CO LTD | TWD | 9.104.023,66 | 2,91 |
| 13.230 | HIWIN TECHNOLOGIES CORP | TWD | 146.533,45 | 0,05 |
| 1.070.000 | KINSUS INTERCONNECT TECHNOLOGY CORP | TWD | 7.734.841,49 | 2,48 |
| 613.000 | MERIDA INDUSTRY CO LTD | TWD | 6.416.565,27 | 2,05 |
| 758.000 | NAN YA PRINTED CIRCUIT BOARD CORP | TWD | 11.799.802,36 | 3,78 |
| 762.000 | TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFACTURING CO LTD | TWD | 15.816.093,94 | 5,06 |
| | | | **51.017.860,17** | **16,33** |
| | **Hongkong** | | | |
| 1.033.000 | AIA GROUP LTD | HKD | 11.900.564,86 | 3,81 |
| 271.500 | HONG KONG EXCHANGES & CLEARING LTD | HKD | 16.683.845,63 | 5,34 |
| | | | **28.584.410,49** | **9,15** |
| | **Bermuda** | | | |
| 3.469.600 | MAN WAH HOLDINGS LTD | HKD | 5.101.376,55 | 1,63 |
| | | | **5.101.376,55** | **1,63** |
| | | | **308.917.253,59** | **98,87** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **308.917.253,59** | **98,87** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **308.917.253,59** | **98,87** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **0,00** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **2.288.319,59** | **0,73** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **1.238.769,36** | **0,40** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **312.444.342,54** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 1.419.120.341,76 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.093.881.445,95 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.064.447.345,91 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.688,70 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.766,02 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.741,06 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 97,69 |
| | 30.09.2020 | GBP | - |
| | 30.09.2019 | GBP | - |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.818,07 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.846,26 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.706,07 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 28,02 |
| | 30.09.2020 | EUR | 28,42 |
| | 30.09.2019 | EUR | 28,32 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 271,54 |
| | 30.09.2020 | EUR | 275,98 |
| | 30.09.2019 | EUR | 275,56 |
| Capitalisation P Hedged (i) (SEK) | 30.09.2021 | SEK | 103,80 |
| | 30.09.2020 | SEK | 105,05 |
| | 30.09.2019 | SEK | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 262,82 |
| | 30.09.2020 | EUR | 266,58 |
| | 30.09.2019 | EUR | 265,64 |
| Capitalisation T (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.699,77 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.773,81 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.745,39 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 248,72 |
| | 30.09.2020 | EUR | 253,69 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.981,16 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.159,50 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.235,07 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.227,26 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 261,37 |
| | 30.09.2020 | EUR | 265,64 |
| | 30.09.2019 | EUR | 265,25 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 242,69 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 100,61 |
| | 30.09.2020 | GBP | - |
| | 30.09.2019 | GBP | - |
| Distribution R Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 251,28 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.659,76 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.742,33 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.734,07 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 118.995 |
| | 30.09.2020 | 98.617 |
| | 30.09.2019 | 126.425 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 1.487 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 858 |
| | 30.09.2020 | 78 |
| | 30.09.2019 | 66 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 4.601.215 |
| | 30.09.2020 | 3.175.670 |
| | 30.09.2019 | 1.614.284 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 239.897 |
| | 30.09.2020 | 138.806 |
| | 30.09.2019 | 23.667 |
| Capitalisation P Hedged (i) (SEK) | 30.09.2021 | 3.573 |
| | 30.09.2020 | 593 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 119.498 |
| | 30.09.2020 | 101.431 |
| | 30.09.2019 | 15.546 |
| Capitalisation T (EUR) | 30.09.2021 | 17.565 |
| | 30.09.2020 | 9.830 |
| | 30.09.2019 | 11.622 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 7.110 |
| | 30.09.2020 | 1.139 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 3.288 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 42.468 |
| | 30.09.2020 | 36.693 |
| | 30.09.2019 | 36.141 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 33.680 |
| | 30.09.2020 | 25.462 |
| | 30.09.2019 | 7.251 |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 33.355 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 20 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution R Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 8 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | 27.905 |
| | 30.09.2020 | 19.743 |
| | 30.09.2019 | 4.239 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 5,55 |
| Distribution Z (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 17,45 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,33% |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,35% |
| Capitalisation I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 0,35% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,40% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Capitalisation P Hedged (i) (SEK) | 30.09.2021 | 0,62% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,40% |
| Capitalisation T (EUR) | 30.09.2021 | 0,27% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,13% |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | 0,33% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 0,40% |
| Distribution R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,40% |
| Distribution R Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 0,40% |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,13% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (28,84%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **1.378.107.018,87** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 1.378.107.018,87 |
| **Bankguthaben** | | **31.825.284,37** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **6.583.259,87** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **13.060.348,71** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***1.429.575.911,82*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(7.862.937,17)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(2.592.632,89)** |
| Devisentermingeschäfte | | (348.061,34) |
| Futures | | (2.244.571,55) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(10.455.570,06)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.419.120.341,76*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **9.203.621,54** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 9.200.129,84 |
| Sonstige Erträge | 10 | 3.491,70 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(4.668.121,10)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.550.324,52) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.713.408,95) |
| Abonnementsteuer | 9 | (235.336,36) |
| Bankzinsen | | (168.497,78) |
| Sonstige Ausgaben | 11 | (553,49) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **4.535.500,44** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 5.459.290,63 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.240.603,68) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 16.657.709,40 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (14.754.945,02) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 161.073,45 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (148.387,29) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (29.085.532,97) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (3.875.821,26) |
| **Ergebnis** | | **(22.291.716,30)** |
| Zeichnungen | | 794.725.690,76 |
| Rücknahmen | | (446.620.969,87) |
| Ausschüttung | | (574.108,78) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 1.093.881.445,95 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***1.419.120.341,76*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Anleihen und andere Schuldtitel

**Niederlande**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 4.701.000 | ABN AMRO BANK NV 0.875% 22/04/2025 EMTN | EUR | 4.874.766,73 | 0,34 |
| 11.719.000 | ALLIANDER NV 0.375% 10/06/2030 EMTN | EUR | 11.821.867,62 | 0,83 |
| 8.400.000 | ALLIANDER NV 0.875% 22/04/2026 EMTN | EUR | 8.761.081,06 | 0,62 |
| 8.607.000 | ALLIANDER NV 0.875% 24/06/2032 EMTN | EUR | 9.002.854,95 | 0,63 |
| 12.088.000 | CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN | EUR | 12.130.396,12 | 0,85 |
| 4.036.000 | CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN | EUR | 3.993.551,37 | 0,28 |
| 13.800.000 | DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN | EUR | 14.480.041,23 | 1,02 |
| 4.705.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032 | EUR | 4.611.514,85 | 0,32 |
| 5.942.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030 | EUR | 6.241.400,33 | 0,44 |
| 2.778.000 | DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031 | EUR | 2.657.064,19 | 0,19 |
| 10.151.000 | EDP FINANCE BV 0.375% 16/09/2026 EMTN | EUR | 10.266.504,88 | 0,72 |
| 4.253.000 | EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN | EUR | 4.572.819,26 | 0,32 |
| 6.467.000 | ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 1.875% 31/10/2033 EMTN | EUR | 7.387.224,68 | 0,52 |
| 6.138.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.000% 16/09/2024 EMTN | EUR | 6.341.261,53 | 0,45 |
| 12.605.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN | EUR | 13.227.135,28 | 0,93 |
| 5.623.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.500% 21/07/2025 EMTN | EUR | 5.938.477,23 | 0,42 |
| 9.307.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 19/10/2027 EMTN | EUR | 9.874.631,23 | 0,70 |
| 6.100.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 6.595.566,01 | 0,46 |
| 7.300.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 7.327.910,60 | 0,52 |
| 7.700.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 7.866.435,89 | 0,55 |
| 6.200.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP EMTN | EUR | 6.525.124,03 | 0,46 |
| 2.500.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV 0.375% 15/09/2025 EMTN | EUR | 2.548.420,35 | 0,18 |
| 6.400.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.125% 21/04/2026 EMTN | EUR | 6.752.353,47 | 0,48 |
| 22.000.000 | ING GROEP NV 01/07/2026 FRN | USD | 19.021.316,55 | 1,34 |
| 3.600.000 | ING GROEP NV 09/06/2032 FRN EMTN | EUR | 3.602.841,88 | 0,25 |
| 5.200.000 | ING GROEP NV 2.500% 15/11/2030 EMTN | EUR | 6.134.984,60 | 0,43 |
| 6.000.000 | LEASEPLAN CORP NV 3.500% 09/04/2025 EMTN | EUR | 6.713.194,14 | 0,47 |
| 9.300.000 | NATURGY FINANCE BV 0.875% 15/05/2025 EMTN | EUR | 9.598.848,90 | 0,68 |
| 29.211.207 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/01/2040 | EUR | 30.830.795,21 | 2,18 |
| 9.607.000 | SWISSCOM FINANCE BV 0.375% 14/11/2028 | EUR | 9.734.843,42 | 0,69 |
| 1.100.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 1.124.046,57 | 0,08 |
| 5.591.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 5.892.115,33 | 0,42 |
| 7.490.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 7.849.546,14 | 0,55 |
| 5.155.000 | TENNET HOLDING BV 0.500% 30/11/2040 EMTN | EUR | 4.672.308,79 | 0,33 |
| 10.898.000 | TENNET HOLDING BV 0.875% 03/06/2030 EMTN | EUR | 11.333.831,73 | 0,80 |
| 5.716.000 | TENNET HOLDING BV 1.000% 13/06/2026 EMTN | EUR | 5.981.101,68 | 0,42 |
| 7.097.000 | TENNET HOLDING BV 1.375% 05/06/2028 EMTN | EUR | 7.626.814,19 | 0,54 |
| 5.000.000 | TENNET HOLDING BV 1.375% 26/06/2029 EMTN | EUR | 5.403.562,40 | 0,38 |
| 5.368.000 | TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN | EUR | 5.802.583,51 | 0,41 |
| 1.675.000 | TENNET HOLDING BV 1.750% 04/06/2027 EMTN | EUR | 1.831.699,11 | 0,13 |
| 5.540.000 | TENNET HOLDING BV 1.875% 13/06/2036 EMTN | EUR | 6.320.825,16 | 0,45 |
| 4.503.000 | TENNET HOLDING BV 2.000% 05/06/2034 EMTN | EUR | 5.194.213,56 | 0,37 |
| 9.627.000 | VESTEDA FINANCE BV 1.500% 24/05/2027 EMTN | EUR | 10.269.467,38 | 0,72 |
| 4.000.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0.875% 22/09/2028 EMTN | EUR | 4.120.147,36 | 0,29 |
| 8.000.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.250% 23/09/2032 EMTN | EUR | 8.297.735,20 | 0,58 |
| | | | **351.155.225,70** | **24,74** |

**Frankreich**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 9.700.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN | EUR | 9.648.769,55 | 0,68 |
| 9.100.000 | BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN | EUR | 9.234.822,42 | 0,65 |
| 5.100.000 | BNP PARIBAS SA 1.125% 28/08/2024 EMTN | EUR | 5.283.157,63 | 0,37 |
| 7.400.000 | BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN | EUR | 7.421.588,39 | 0,52 |
| 2.000.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 0.100% 13/11/2029 EMTN | EUR | 2.011.177,24 | 0,14 |
| 9.000.000 | CNP ASSURANCES 27/07/2050 FRN | EUR | 9.399.382,38 | 0,66 |
| 300.000 | COVIVIO 1.125% 17/09/2031 | EUR | 313.211,10 | 0,02 |
| 2.200.000 | COVIVIO 1.875% 20/05/2026 | EUR | 2.388.356,06 | 0,17 |
| 11.200.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.050% 06/12/2029 EMTN | EUR | 11.211.456,93 | 0,79 |
| 14.500.000 | CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 21/10/2025 EMTN | EUR | 14.688.561,48 | 1,04 |
| 2.900.000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA 1.000% 13/10/2026 EMTN | EUR | 3.027.928,51 | 0,21 |
| 300.000 | ENGIE SA FRN PERP | EUR | 324.000,00 | 0,02 |
| 3.800.000 | ENGIE SA FRN PERP | EUR | 3.819.627,46 | 0,27 |
| 5.200.000 | ENGIE SA FRN PERP | EUR | 5.271.347,90 | 0,37 |
| 7.600.000 | ENGIE SA 0.375% 21/06/2027 EMTN | EUR | 7.691.925,65 | 0,54 |
| 2.600.000 | ENGIE SA 1.375% 21/06/2039 EMTN | EUR | 2.724.883,04 | 0,19 |
| 3.800.000 | ENGIE SA 1.375% 28/02/2029 EMTN | EUR | 4.080.131,93 | 0,29 |
| 3.400.000 | ENGIE SA 1.750% 27/03/2028 EMTN | EUR | 3.712.441,81 | 0,26 |
| 5.000.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/06/2044 | EUR | 4.773.741,00 | 0,34 |
| 78.409.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/06/2039 | EUR | 94.954.493,17 | 6,70 |
| 10.200.000 | LA BANQUE POSTALE SA 1.375% 24/04/2029 EMTN | EUR | 10.824.257,14 | 0,76 |
| 4.500.000 | LA POSTE SA 1.450% 30/11/2028 EMTN | EUR | 4.899.571,38 | 0,35 |
| 1.600.000 | REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 0.875% 25/05/2027 EMTN | EUR | 1.685.524,00 | 0,12 |
| 7.800.000 | SNCF RESEAU 0.750% 25/05/2036 EMTN | EUR | 7.932.671,21 | 0,56 |
| 8.000.000 | SNCF RESEAU 1.000% 09/11/2031 EMTN | EUR | 8.501.690,40 | 0,60 |
| 7.000.000 | SNCF RESEAU 1.875% 30/03/2034 EMTN | EUR | 8.122.569,49 | 0,57 |
| 4.000.000 | SNCF RESEAU 2.250% 20/12/2047 EMTN | EUR | 5.019.285,80 | 0,35 |
| 14.300.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 0.700% 15/10/2060 EMTN | EUR | 12.153.010,01 | 0,86 |
| 10.600.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.000% 18/02/2070 EMTN | EUR | 9.640.789,36 | 0,68 |
| 14.500.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.125% 22/10/2028 EMTN | EUR | 15.677.721,76 | 1,10 |
| 8.900.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.700% 25/05/2050 EMTN | EUR | 10.366.175,85 | 0,73 |
| 12.500.000 | SOCIETE NATIONALE SNCF SA 0.625% 17/04/2030 EMTN | EUR | 12.900.538,38 | 0,91 |
| 1.721.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.000% 14/03/2025 EMTN | EUR | 1.791.477,41 | 0,13 |
| 4.008.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 2.500% 26/02/2024 EMTN | EUR | 4.279.743,96 | 0,30 |
| | | | **315.776.029,80** | **22,25** |

**Spanien**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 2.600.000 | ACS SERVICIOS COMUNICACIONES Y ENERGIA SA 1.875% 20/04/2026 | EUR | 2.746.119,01 | 0,19 |
| 5.800.000 | ADIF ALTA VELOCIDAD 1.250% 04/05/2026 EMTN | EUR | 6.170.050,90 | 0,43 |
| 7.696.000 | AUTONOMOUS COMMUNITY OF MADRID SPAIN 0.827% 30/07/2027 | EUR | 8.057.949,96 | 0,57 |
| 21.700.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.000% 21/06/2026 | EUR | 22.597.241,84 | 1,60 |
| 3.700.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.375% 14/05/2025 GMTN | EUR | 3.881.508,79 | 0,27 |
| 6.100.000 | BANCO DE SABADELL SA 11/03/2027 FRN | EUR | 6.274.928,72 | 0,44 |
| 5.100.000 | BANCO DE SABADELL SA 16/06/2028 FRN EMTN | EUR | 5.021.106,42 | 0,35 |
| 7.800.000 | BANCO SANTANDER SA 0.300% 04/10/2026 EMTN | EUR | 7.868.091,27 | 0,55 |
| 11.300.000 | BANCO SANTANDER SA 1.125% 23/06/2027 EMTN | EUR | 11.770.305,10 | 0,83 |
| 8.700.000 | CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN | EUR | 8.589.049,51 | 0,61 |
| 7.000.000 | CAIXABANK SA 18/11/2026 FRN EMTN | EUR | 7.024.732,96 | 0,50 |
| 6.200.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 0.875% 16/06/2025 EMTN | EUR | 6.419.822,43 | 0,45 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.000.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 1.000% 07/03/2025 EMTN | EUR | 2.075.475,96 | 0,15 |
| 3.000.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 1.250% 13/09/2027 EMTN | EUR | 3.215.632,14 | 0,23 |
| 7.600.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 1.250% 28/10/2026 EMTN | EUR | 8.074.844,43 | 0,57 |
| 6.300.000 | RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU 0.375% 24/07/2028 EMTN | EUR | 6.405.623,22 | 0,45 |
| 2.938.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.000% 30/07/2042 | EUR | 2.900.489,76 | 0,20 |
| 8.000.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.069% 05/02/2024 EMTN | EUR | 8.220.979,84 | 0,58 |
| | | | **127.313.952,26** | **8,97** |
| | **Deutschland** | | | |
| 4.300.000 | ADIDAS AG ZCP 05/10/2028 | EUR | 4.269.294,90 | 0,30 |
| 2.300.000 | BERLIN HYP AG 0.500% 26/09/2023 EMTN | EUR | 2.331.102,67 | 0,16 |
| 2.600.000 | BERLIN HYP AG 1.125% 25/10/2027 EMTN | EUR | 2.734.138,76 | 0,19 |
| 4.000.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2050 | EUR | 3.743.453,52 | 0,26 |
| 7.110.000 | DAIMLER AG 0.750% 10/09/2030 EMTN | EUR | 7.303.663,25 | 0,51 |
| 7.661.000 | DAIMLER AG 0.750% 11/03/2033 EMTN | EUR | 7.688.002,19 | 0,54 |
| 10.386.000 | DEUTSCHE KREDITBANK AG 0.010% 23/02/2026 | EUR | 10.387.235,00 | 0,73 |
| 8.500.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/08/2079 FRN | EUR | 8.634.397,33 | 0,61 |
| 12.000.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/11/2079 FRN | EUR | 12.134.869,68 | 0,86 |
| 6.400.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 31/08/2081 FRN | EUR | 6.324.561,66 | 0,45 |
| 2.623.000 | E.ON SE ZCP 28/08/2024 EMTN | EUR | 2.636.174,91 | 0,19 |
| 5.800.000 | E.ON SE 0.350% 28/02/2030 EMTN | EUR | 5.748.486,20 | 0,41 |
| 9.058.000 | E.ON SE 0.375% 29/09/2027 EMTN | EUR | 9.166.027,70 | 0,65 |
| 4.649.000 | E.ON SE 0.875% 20/08/2031 EMTN | EUR | 4.785.307,98 | 0,34 |
| 9.300.000 | EUROGRID GMBH 1.113% 15/05/2032 EMTN | EUR | 9.772.843,06 | 0,69 |
| 2.900.000 | LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.375% 24/05/2024 EMTN | EUR | 2.942.908,66 | 0,21 |
| 9.700.000 | LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.375% 29/07/2026 EMTN | EUR | 9.853.061,05 | 0,69 |
| 600.000 | NRW BANK 0.625% 02/02/2029 EMTN | EUR | 628.671,18 | 0,04 |
| 3.600.000 | ZF FINANCE GMBH 2.000% 06/05/2027 EMTN | EUR | 3.618.275,98 | 0,25 |
| | | | **114.702.475,68** | **8,08** |
| | **Italien** | | | |
| 5.129.000 | ACEA SPA 0.250% 28/07/2030 EMTN | EUR | 4.970.567,04 | 0,35 |
| 5.614.000 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.124% 01/10/2030 EMTN | EUR | 5.975.556,87 | 0,42 |
| 3.600.000 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.429% 14/07/2031 EMTN | EUR | 3.888.000,00 | 0,27 |
| 5.000.000 | CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 0.125% 15/03/2033 | EUR | 4.903.049,50 | 0,35 |
| 3.691.000 | ERG SPA 0.875% 15/09/2031 EMTN | EUR | 3.683.197,23 | 0,26 |
| 3.178.000 | FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 1.125% 09/07/2026 EMTN | EUR | 3.341.733,71 | 0,24 |
| 2.125.000 | HERA SPA 0.875% 05/07/2027 EMTN | EUR | 2.203.316,07 | 0,16 |
| 457.000 | HERA SPA 2.375% 04/07/2024 EMTN | EUR | 488.274,57 | 0,03 |
| 8.700.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 04/12/2024 EMTN | EUR | 8.915.300,21 | 0,63 |
| 5.500.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN | EUR | 5.568.187,46 | 0,39 |
| 26.000.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.500% 30/04/2045 | EUR | 25.312.604,98 | 1,78 |
| 6.385.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 1.625% 18/01/2029 EMTN | EUR | 6.256.545,23 | 0,44 |
| | | | **75.506.332,87** | **5,32** |
| | **Belgien** | | | |
| 35.306.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.250% 22/04/2033 | EUR | 39.690.895,40 | 2,80 |
| 17.200.000 | KBC GROUP NV 16/06/2027 FRN EMTN | EUR | 17.373.839,02 | 1,22 |
| | | | **57.064.734,42** | **4,02** |
| | **Schweden** | | | |
| 16.500.000 | SBAB BANK AB 0.500% 13/05/2025 EMTN | EUR | 16.894.400,49 | 1,20 |
| 1.797.000 | SKF AB 0.875% 15/11/2029 EMTN | EUR | 1.863.208,70 | 0,13 |
| 10.055.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.010% 02/12/2027 EMTN | EUR | 9.913.719,91 | 0,70 |
| 2.287.000 | TELIA CO AB 11/05/2081 FRN | EUR | 2.332.962,41 | 0,16 |
| 5.100.000 | VATTENFALL AB 0.050% 15/10/2025 EMTN | EUR | 5.117.760,70 | 0,36 |
| 10.558.000 | VATTENFALL AB 0.125% 12/02/2029 EMTN | EUR | 10.378.551,38 | 0,73 |
| 5.773.000 | VATTENFALL AB 0.500% 24/06/2026 EMTN | EUR | 5.888.709,39 | 0,41 |
| | | | **52.389.312,98** | **3,69** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 12.320.000 | APPLE INC ZCP 15/11/2025 | EUR | 12.414.819,03 | 0,88 |
| 2.715.000 | APPLE INC 3.000% 20/06/2027 | USD | 2.560.488,12 | 0,18 |
| 9.521.000 | DIGITAL EURO FINCO LLC 2.500% 16/01/2026 | EUR | 10.398.750,32 | 0,73 |
| 4.600.000 | EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033 | EUR | 4.572.167,61 | 0,32 |
| 2.495.000 | PEPSICO INC 2.875% 15/10/2049 | USD | 2.192.309,81 | 0,15 |
| 4.379.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.875% 08/02/2029 | USD | 4.240.688,93 | 0,30 |
| 9.530.000 | VF CORP 0.250% 25/02/2028 | EUR | 9.486.514,04 | 0,67 |
| | | | **45.865.737,86** | **3,23** |
| | **Irland** | | | |
| 25.875.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.350% 18/03/2031 | EUR | 28.991.541,80 | 2,04 |
| 3.674.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033 | EUR | 3.653.797,96 | 0,26 |
| | | | **32.645.339,76** | **2,30** |
| | **Finnland** | | | |
| 12.074.000 | NORDEA BANK ABP 0.375% 28/05/2026 EMTN | EUR | 12.337.109,36 | 0,87 |
| 6.080.000 | STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN | EUR | 6.083.438,60 | 0,43 |
| 10.950.000 | UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN | EUR | 10.766.448,98 | 0,76 |
| | | | **29.186.996,94** | **2,06** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 8.386.000 | HSBC HOLDINGS PLC 04/12/2024 FRN EMTN | EUR | 8.683.508,28 | 0,61 |
| 13.310.000 | NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANSMISSION PLC 0.190% 20/01/2025 | EUR | 13.404.197,93 | 0,95 |
| 4.028.000 | NATIONAL GRID PLC 0.250% 01/09/2028 EMTN | EUR | 3.984.047,79 | 0,28 |
| | | | **26.071.754,00** | **1,84** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 6.172.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 0.875% 09/07/2029 EMTN | EUR | 6.341.261,30 | 0,45 |
| 1.688.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN | EUR | 1.811.173,63 | 0,13 |
| 4.577.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.750% 15/03/2028 EMTN | EUR | 4.975.990,50 | 0,35 |
| 7.107.000 | SEGRO CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031 | EUR | 6.955.738,95 | 0,49 |
| 3.000.000 | SELP FINANCE SARL 0.875% 27/05/2029 | EUR | 3.006.576,12 | 0,21 |
| | | | **23.090.740,50** | **1,63** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 5.351.000 | EUROFIMA 0.100% 20/05/2030 EMTN | EUR | 5.325.672,33 | 0,38 |
| 9.798.000 | EUROFIMA 0.150% 10/10/2034 EMTN | EUR | 9.411.000,85 | 0,67 |
| 482.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.500% 13/11/2037 EMTN | EUR | 493.481,76 | 0,03 |
| 4.041.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.500% 15/11/2047 | EUR | 4.932.154,98 | 0,35 |
| | | | **20.162.309,92** | **1,43** |
| | **Chile** | | | |
| 11.988.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.830% 02/07/2031 | EUR | 11.959.774,13 | 0,84 |
| 5.365.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.250% 29/01/2040 | EUR | 5.183.931,25 | 0,37 |
| | | | **17.143.705,38** | **1,21** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Ungarn** | | | |
| 12.557.000 | HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.750% 05/06/2035 | EUR | 13.188.384,92 | 0,93 |
| | | | **13.188.384,92** | **0,93** |
| | **Österreich** | | | |
| 3.400.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 17/06/2033 FRN | EUR | 3.408.062,39 | 0,24 |
| 3.700.000 | VERBUND AG 0.900% 01/04/2041 | EUR | 3.719.506,81 | 0,27 |
| 2.200.000 | VERBUND AG 1.500% 20/11/2024 | EUR | 2.321.853,36 | 0,16 |
| | | | **9.449.422,56** | **0,67** |
| | **Norwegen** | | | |
| 5.000.000 | DNB BOLIGKREDITT AS 0.010% 21/01/2031 | EUR | 4.939.851,10 | 0,34 |
| 4.443.000 | SPAREBANKEN SOER BOLIGKREDITT AS 0.010% 26/10/2026 | EUR | 4.481.815,43 | 0,32 |
| | | | **9.421.666,53** | **0,66** |
| | **Dänemark** | | | |
| 1.778.000 | KOMMUNEKREDIT 0.625% 21/11/2039 | EUR | 1.789.703,85 | 0,13 |
| 2.883.000 | ORSTED AS 1.500% 26/11/2029 | EUR | 3.140.117,88 | 0,22 |
| 985.000 | ORSTED AS 18/02/3021 FRN | EUR | 983.683,32 | 0,07 |
| 3.077.000 | ORSTED AS 24/11/3017 FRN | EUR | 3.223.481,79 | 0,22 |
| | | | **9.136.986,84** | **0,64** |
| | **Südkorea** | | | |
| 4.132.000 | LG CHEM LTD 3.625% 15/04/2029 | USD | 3.910.240,25 | 0,28 |
| 5.950.000 | SK HYNIX INC 2.375% 19/01/2031 | USD | 4.991.085,43 | 0,35 |
| | | | **8.901.325,68** | **0,63** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 8.700.000 | CESKA SPORITELNA AS 13/09/2028 FRN EMTN | EUR | 8.683.735,00 | 0,62 |
| | | | **8.683.735,00** | **0,62** |
| | **Litauen** | | | |
| 2.637.000 | AB IGNITIS GRUPE 1.875% 10/07/2028 EMTN | EUR | 2.879.899,11 | 0,21 |
| 2.649.000 | AB IGNITIS GRUPE 2.000% 14/07/2027 EMTN | EUR | 2.901.722,73 | 0,21 |
| | | | **5.781.621,84** | **0,42** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 3.732.000 | FIBRIA OVERSEAS FINANCE LTD 5.500% 17/01/2027 | USD | 3.682.975,60 | 0,26 |
| 2.093.000 | MTR CORP CI LTD 2.500% 02/11/2026 EMTN | USD | 1.904.138,37 | 0,13 |
| | | | **5.587.113,97** | **0,39** |
| | **Hongkong** | | | |
| 4.955.000 | MTR CORP LTD 1.625% 19/08/2030 EMTN | USD | 4.158.249,00 | 0,29 |
| | | | **4.158.249,00** | **0,29** |
| | **Portugal** | | | |
| 3.500.000 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 1.625% 15/04/2027 EMTN | EUR | 3.751.402,66 | 0,26 |
| | | | **3.751.402,66** | **0,26** |
| | **Japan** | | | |
| 3.628.000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.848% 19/07/2029 | EUR | 3.734.168,85 | 0,26 |
| | | | **3.734.168,85** | **0,26** |
| | **Mexiko** | | | |
| 3.530.000 | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV 1.850% 01/09/2032 | USD | 2.886.592,67 | 0,20 |
| | | | **2.886.592,67** | **0,20** |
| | **Indonesien** | | | |
| 3.028.000 | PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 3.750% 01/03/2023 | USD | 2.726.719,13 | 0,19 |
| | | | **2.726.719,13** | **0,19** |
| | **Indien** | | | |
| 2.613.000 | POWER FINANCE CORP LTD 1.841% 21/09/2028 GMTN | EUR | 2.624.981,15 | 0,18 |
| | | | **2.624.981,15** | **0,18** |
| | | | **1.378.107.018,87** | **97,11** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **1.378.107.018,87** | **97,11** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 5.104.774,19 | USD | 4.302.304,12 | EUR | 19/10/2021 | 4.302.304,12 | 101.050,85 |
| 377.359,88 | SEK | 37.011,46 | EUR | 19/10/2021 | 37.011,46 | 199,87 |
| 149.536,41 | GBP | 173.766,30 | EUR | 19/10/2021 | 173.766,30 | 159,77 |
| 1.304,96 | EUR | 1.123,04 | GBP | 19/10/2021 | 1.304,96 | (1,25) |
| 9.240,93 | EUR | 10.964,10 | USD | 19/10/2021 | 9.240,93 | (216,66) |
| 53.544.872,94 | EUR | 62.607.000,00 | USD | 29/10/2021 | 53.544.872,94 | (449.253,92) |
| | | | | | **58.068.500,71** | **(348.061,34)** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| (141) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 19.025.130,00 | 96.840,00 |
| (109) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 18.510.380,00 | 194.950,00 |
| 459 | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 93.333.060,00 | (3.050.040,00) |
| (13) | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 2.143.157,60 | 59.327,68 |
| (72) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 8.176.258,68 | 93.187,80 |
| (115) | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 14.412.830,58 | 227.906,69 |
| (44) | US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 8.354.464,19 | 4.152,45 |
| (228) | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 24.147.045,92 | 129.103,83 |
| | | | **188.102.326,97** | **(2.244.571,55)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(2.592.632,89)** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **1.378.107.018,87** | **97,11** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(2.592.632,89)** | **(0,18)** |
| **Bankguthaben** | **31.825.284,37** | **2,24** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **11.780.671,41** | **0,83** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **1.419.120.341,76** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond Short Duration

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 230.463.162,61 |
| | 30.09.2020 | EUR | 92.214.075,39 |
| | 30.09.2019 | EUR | 115.880.887,08 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 511,06 |
| | 30.09.2020 | EUR | 509,14 |
| | 30.09.2019 | EUR | 509,35 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 102,05 |
| | 30.09.2020 | GBP | 101,09 |
| | 30.09.2019 | GBP | 100,26 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 247,99 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 254,42 |
| | 30.09.2020 | EUR | 253,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 253,98 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 247,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | 248,60 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.658,71 |
| | 30.09.2020 | EUR | 7.637,87 |
| | 30.09.2019 | EUR | 7.640,35 |
| Distribution I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.166,13 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.105,59 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.005,40 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 350.514 |
| | 30.09.2020 | | 135.087 |
| | 30.09.2019 | | 35.349 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | | 37.817 |
| | 30.09.2020 | | 15.987 |
| | 30.09.2019 | | 100 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 17.162 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 67.116 |
| | 30.09.2020 | | 165 |
| | 30.09.2019 | | 15.931 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 1.261 |
| | 30.09.2020 | | 80 |
| | 30.09.2019 | | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | | 142 |
| | 30.09.2020 | | 1.472 |
| | 30.09.2019 | | 10.949 |
| Distribution I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | | 5.409 |
| | 30.09.2020 | | 2.377 |
| | 30.09.2019 | | 2.214 |
| **Dividende** | | | |
| Distribution I (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 8,30 |
| Distribution I Hedged (i) (USD) | 14.12.2020 | USD | 4,35 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,33% |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | | 0,35% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 0,60% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 0,40% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 0,95% |
| Distribution I (EUR) | 30.09.2021 | | 0,32% |
| Distribution I Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | | 0,35% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | (43,45%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Green Bond Short Duration

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **222.531.988,27** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 222.531.988,27 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **3.356.448,79** |
| Devisentermingeschäfte | | 579.216,73 |
| Futures | | 2.777.232,06 |
| **Bankguthaben** | | **896.077,37** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **1.841.445,70** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **3.047.611,18** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***231.673.571,31*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(1.210.408,70)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(1.210.408,70)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***230.463.162,61*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **799.906,25** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 795.865,75 |
| Zinsen auf Swaps | | 3.395,00 |
| Sonstige Erträge | 10 | 645,50 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(549.177,02)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (304.255,89) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (182.145,49) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (5.348,80) |
| Abonnementsteuer | 9 | (19.289,22) |
| Bankzinsen | | (33.015,95) |
| Zinsen auf Swaps | | (5.121,67) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **250.729,23** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 907.923,82 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (221.796,26) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 4.678.483,12 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (5.078.807,45) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 172.208,11 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (49.021,97) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (3.442.005,36) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 3.454.369,22 |
| **Ergebnis** | | **672.082,46** |
| Zeichnungen | | 208.341.526,36 |
| Rücknahmen | | (70.753.879,82) |
| Ausschüttung | | (10.641,78) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 92.214.075,39 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***230.463.162,61*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond Short Duration

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

**Anleihen und andere Schuldtitel**

**Niederlande**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1.000.000 | ABN AMRO BANK NV 0.500% 15/04/2026 EMTN | EUR | 1.024.870,60 | 0,44 |
| 2.600.000 | ALLIANDER NV 0.375% 10/06/2030 EMTN | EUR | 2.622.822,41 | 1,14 |
| 1.200.000 | ALLIANDER NV 0.875% 24/06/2032 EMTN | EUR | 1.255.190,65 | 0,54 |
| 1.000.000 | CTP NV 0.625% 27/11/2023 EMTN | EUR | 1.012.881,81 | 0,44 |
| 1.584.000 | CTP NV 0.750% 18/02/2027 EMTN | EUR | 1.589.555,55 | 0,69 |
| 700.000 | CTP NV 1.500% 27/09/2031 EMTN | EUR | 692.637,75 | 0,30 |
| 1.100.000 | DE VOLKSBANK NV 0.010% 16/09/2024 EMTN | EUR | 1.107.730,55 | 0,48 |
| 2.000.000 | DE VOLKSBANK NV 22/10/2030 FRN EMTN | EUR | 2.098.556,70 | 0,91 |
| 590.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.000% 15/01/2032 | EUR | 578.277,10 | 0,25 |
| 1.000.000 | DIGITAL DUTCH FINCO BV 1.500% 15/03/2030 | EUR | 1.050.387,13 | 0,46 |
| 700.000 | DIGITAL INTREPID HOLDING BV 0.625% 15/07/2031 | EUR | 669.526,61 | 0,29 |
| 600.000 | EDP FINANCE BV 0.375% 16/09/2026 EMTN | EUR | 606.827,20 | 0,26 |
| 2.665.000 | EDP FINANCE BV 1.875% 13/10/2025 EMTN | EUR | 2.865.404,03 | 1,24 |
| 836.000 | ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 1.875% 31/10/2033 EMTN | EUR | 954.959,00 | 0,41 |
| 1.600.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.000% 16/09/2024 EMTN | EUR | 1.652.984,43 | 0,72 |
| 2.418.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL NV 1.125% 16/09/2026 EMTN | EUR | 2.537.343,36 | 1,10 |
| 1.791.000 | E.ON INTERNATIONAL FINANCE BV 1.250% 19/10/2027 EMTN | EUR | 1.900.232,57 | 0,82 |
| 1.000.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 1.003.823,37 | 0,44 |
| 1.800.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 1.838.907,09 | 0,80 |
| 2.000.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP | EUR | 2.162.480,66 | 0,94 |
| 1.200.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV FRN PERP EMTN | EUR | 1.262.927,23 | 0,55 |
| 1.000.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV 0.375% 15/09/2025 EMTN | EUR | 1.019.368,14 | 0,44 |
| 300.000 | IBERDROLA INTERNATIONAL BV 1.125% 21/04/2026 EMTN | EUR | 316.516,57 | 0,14 |
| 1.000.000 | ING GROEP NV 01/07/2026 FRN | USD | 864.605,30 | 0,38 |
| 500.000 | ING GROEP NV 09/06/2032 FRN EMTN | EUR | 500.394,71 | 0,22 |
| 1.400.000 | ING GROEP NV 2.500% 15/11/2030 EMTN | EUR | 1.651.726,62 | 0,72 |
| 700.000 | LEASEPLAN CORP NV 1.375% 07/03/2024 EMTN | EUR | 725.940,82 | 0,31 |
| 300.000 | LEASEPLAN CORP NV 3.500% 09/04/2025 EMTN | EUR | 335.659,71 | 0,15 |
| 1.300.000 | NATURGY FINANCE BV 0.875% 15/05/2025 EMTN | EUR | 1.341.774,58 | 0,58 |
| 5.100.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/01/2040 | EUR | 5.382.764,76 | 2,34 |
| 1.437.000 | SWISSCOM FINANCE BV 0.375% 14/11/2028 | EUR | 1.456.122,62 | 0,63 |
| 500.000 | TELEFONICA EUROPE BV FRN PERP | EUR | 510.930,26 | 0,22 |
| 771.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 808.010,69 | 0,35 |
| 900.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 948.471,44 | 0,41 |
| 300.000 | TENNET HOLDING BV 0.500% 30/11/2040 EMTN | EUR | 271.909,34 | 0,12 |
| 1.200.000 | TENNET HOLDING BV 0.875% 03/06/2030 EMTN | EUR | 1.247.990,28 | 0,54 |
| 2.000.000 | TENNET HOLDING BV 1.000% 13/06/2026 EMTN | EUR | 2.092.757,76 | 0,91 |
| 700.000 | TENNET HOLDING BV 1.375% 05/06/2028 EMTN | EUR | 752.257,28 | 0,33 |
| 700.000 | TENNET HOLDING BV 1.375% 26/06/2029 EMTN | EUR | 756.498,74 | 0,33 |
| 1.144.000 | TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN | EUR | 1.236.616,16 | 0,54 |
| 1.342.000 | TENNET HOLDING BV 1.875% 13/06/2036 EMTN | EUR | 1.531.145,73 | 0,66 |
| 1.264.000 | TENNET HOLDING BV 2.000% 05/06/2034 EMTN | EUR | 1.458.024,86 | 0,63 |
| 1.445.000 | VESTEDA FINANCE BV 1.500% 24/05/2027 EMTN | EUR | 1.541.433,51 | 0,67 |
| 400.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 0.875% 22/09/2028 EMTN | EUR | 412.014,74 | 0,18 |
| 1.400.000 | VOLKSWAGEN INTERNATIONAL FINANCE NV 1.250% 23/09/2032 EMTN | EUR | 1.452.103,66 | 0,63 |
| | | | **59.103.364,08** | **25,65** |

**Frankreich**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1.300.000 | BANQUE FEDERATIVE DU CREDIT MUTUEL SA 0.100% 08/10/2027 EMTN | EUR | 1.293.134,06 | 0,56 |
| 1.200.000 | BNP PARIBAS SA 04/06/2026 FRN | EUR | 1.217.778,78 | 0,53 |
| 2.600.000 | BNP PARIBAS SA 1.125% 28/08/2024 EMTN | EUR | 2.693.374,48 | 1,17 |
| 600.000 | BNP PARIBAS SA 14/10/2027 FRN EMTN | EUR | 601.750,41 | 0,26 |
| 500.000 | CAISSE FRANCAISE DE FINANCEMENT LOCAL 0.100% 13/11/2029 EMTN | EUR | 502.794,31 | 0,22 |
| 1.600.000 | CNP ASSURANCES 27/07/2050 FRN | EUR | 1.671.001,31 | 0,73 |
| 400.000 | COVIVIO 1.875% 20/05/2026 | EUR | 434.246,56 | 0,19 |
| 1.500.000 | CREDIT AGRICOLE HOME LOAN SFH SA 0.050% 06/12/2029 EMTN | EUR | 1.501.534,41 | 0,65 |
| 2.800.000 | CREDIT AGRICOLE SA 0.375% 21/10/2025 EMTN | EUR | 2.836.411,87 | 1,23 |
| 1.000.000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA 1.000% 13/10/2026 EMTN | EUR | 1.044.113,28 | 0,45 |
| 800.000 | ENGIE SA FRN PERP | EUR | 804.132,10 | 0,35 |
| 1.000.000 | ENGIE SA FRN PERP | EUR | 1.013.720,75 | 0,44 |
| 800.000 | ENGIE SA 0.375% 21/06/2027 EMTN | EUR | 809.676,38 | 0,35 |
| 200.000 | ENGIE SA 1.375% 21/06/2039 EMTN | EUR | 209.606,39 | 0,09 |
| 600.000 | ENGIE SA 1.375% 28/02/2029 EMTN | EUR | 644.231,36 | 0,28 |
| 400.000 | ENGIE SA 1.750% 27/03/2028 EMTN | EUR | 436.757,86 | 0,19 |
| 2.500.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/06/2044 | EUR | 2.386.870,50 | 1,04 |
| 10.185.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/06/2039 | EUR | 12.334.190,12 | 5,35 |
| 1.300.000 | LA BANQUE POSTALE SA 1.375% 24/04/2029 EMTN | EUR | 1.379.562,18 | 0,60 |
| 800.000 | LA POSTE SA 1.450% 30/11/2028 EMTN | EUR | 871.034,91 | 0,38 |
| 300.000 | REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 0.875% 25/05/2027 EMTN | EUR | 316.035,75 | 0,14 |
| 1.800.000 | SNCF RESEAU 0.750% 25/05/2036 EMTN | EUR | 1.830.616,43 | 0,79 |
| 1.300.000 | SNCF RESEAU 0.875% 22/01/2029 EMTN | EUR | 1.374.041,96 | 0,60 |
| 800.000 | SNCF RESEAU 1.000% 09/11/2031 EMTN | EUR | 850.169,04 | 0,37 |
| 500.000 | SNCF RESEAU 1.875% 30/03/2034 EMTN | EUR | 580.183,54 | 0,25 |
| 500.000 | SNCF RESEAU 2.250% 20/12/2047 EMTN | EUR | 627.410,73 | 0,27 |
| 2.500.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 0.700% 15/10/2060 EMTN | EUR | 2.124.652,10 | 0,92 |
| 1.800.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.000% 18/02/2070 EMTN | EUR | 1.637.115,17 | 0,71 |
| 1.800.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.125% 22/10/2028 EMTN | EUR | 1.946.199,94 | 0,84 |
| 1.500.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.700% 25/05/2050 EMTN | EUR | 1.747.108,29 | 0,76 |
| 1.900.000 | SOCIETE NATIONALE SNCF SA 0.625% 17/04/2030 EMTN | EUR | 1.960.881,83 | 0,85 |
| 400.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 1.000% 14/03/2025 EMTN | EUR | 416.380,57 | 0,18 |
| 472.000 | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD SE 2.500% 26/02/2024 EMTN | EUR | 504.001,78 | 0,22 |
| | | | **50.600.719,15** | **21,96** |

**Spanien**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 300.000 | ACS SERVICIOS COMUNICACIONES Y ENERGIA SA 1.875% 20/04/2026 | EUR | 316.859,89 | 0,14 |
| 900.000 | ADIF ALTA VELOCIDAD 1.250% 04/05/2026 EMTN | EUR | 957.421,69 | 0,42 |
| 667.000 | AUTONOMOUS COMMUNITY OF MADRID SPAIN 0.827% 30/07/2027 | EUR | 698.369,62 | 0,30 |
| 4.000.000 | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTARIA SA 1.000% 21/06/2026 | EUR | 4.165.390,20 | 1,81 |
| 1.400.000 | BANCO DE SABADELL SA 11/03/2027 FRN | EUR | 1.440.147,58 | 0,62 |
| 600.000 | BANCO DE SABADELL SA 16/06/2028 FRN EMTN | EUR | 590.718,40 | 0,26 |
| 1.600.000 | BANCO SANTANDER SA 0.300% 04/10/2026 EMTN | EUR | 1.613.967,44 | 0,70 |
| 2.000.000 | BANCO SANTANDER SA 1.125% 23/06/2027 EMTN | EUR | 2.083.239,84 | 0,90 |
| 1.200.000 | CAIXABANK SA 09/02/2029 FRN EMTN | EUR | 1.184.696,48 | 0,51 |
| 1.400.000 | CAIXABANK SA 18/11/2026 FRN EMTN | EUR | 1.404.946,59 | 0,61 |
| 600.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 0.875% 16/06/2025 EMTN | EUR | 621.273,14 | 0,27 |
| 1.000.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 1.000% 07/03/2025 EMTN | EUR | 1.037.737,98 | 0,45 |
| 500.000 | IBERDROLA FINANZAS SA 1.250% 28/10/2026 EMTN | EUR | 531.239,77 | 0,23 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond Short Duration

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.400.000 | RED ELECTRICA FINANCIACIONES SAU 0.375% 24/07/2028 EMTN | EUR | 1.423.471,83 | 0,62 |
| 498.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.000% 30/07/2042 | EUR | 491.641,90 | 0,21 |
| 3.500.000 | TELEFONICA EMISIONES SA 1.069% 05/02/2024 EMTN | EUR | 3.596.678,68 | 1,56 |
| | | | **22.157.801,03** | **9,61** |
| | **Deutschland** | | | |
| 400.000 | ADIDAS AG ZCP 05/10/2028 | EUR | 397.143,71 | 0,17 |
| 500.000 | BERLIN HYP AG 1.125% 25/10/2027 EMTN | EUR | 525.795,92 | 0,23 |
| 2.000.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2050 | EUR | 1.871.726,76 | 0,81 |
| 1.795.000 | DAIMLER AG 0.750% 10/09/2030 EMTN | EUR | 1.843.892,48 | 0,80 |
| 643.000 | DAIMLER AG 0.750% 11/03/2033 EMTN | EUR | 645.266,34 | 0,28 |
| 2.471.000 | DEUTSCHE KREDITBANK AG 0.010% 23/02/2026 | EUR | 2.471.293,83 | 1,08 |
| 300.000 | DEUTSCHE KREDITBANK AG 0.750% 26/09/2024 | EUR | 307.337,88 | 0,13 |
| 1.200.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/08/2079 FRN | EUR | 1.218.973,74 | 0,53 |
| 1.900.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/11/2079 FRN | EUR | 1.921.354,37 | 0,83 |
| 500.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 29/06/2080 FRN | EUR | 516.809,83 | 0,22 |
| 1.000.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 31/08/2081 FRN | EUR | 988.212,76 | 0,43 |
| 500.000 | E.ON SE ZCP 28/08/2024 EMTN | EUR | 502.511,42 | 0,22 |
| 600.000 | E.ON SE 0.350% 28/02/2030 EMTN | EUR | 594.670,99 | 0,26 |
| 2.000.000 | E.ON SE 0.375% 29/09/2027 EMTN | EUR | 2.023.852,44 | 0,88 |
| 660.000 | E.ON SE 0.875% 20/08/2031 EMTN | EUR | 679.351,10 | 0,29 |
| 1.600.000 | EUROGRID GMBH 1.113% 15/05/2032 EMTN | EUR | 1.681.349,34 | 0,73 |
| 1.000.000 | LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.375% 29/07/2026 EMTN | EUR | 1.015.779,49 | 0,44 |
| 500.000 | ZF FINANCE GMBH 2.000% 06/05/2027 EMTN | EUR | 502.538,33 | 0,22 |
| | | | **19.707.860,73** | **8,55** |
| | **Italien** | | | |
| 801.000 | ACEA SPA 0.250% 28/07/2030 EMTN | EUR | 776.257,40 | 0,34 |
| 540.000 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.124% 01/10/2030 EMTN | EUR | 574.777,47 | 0,25 |
| 1.100.000 | ASSICURAZIONI GENERALI SPA 2.429% 14/07/2031 EMTN | EUR | 1.188.000,00 | 0,52 |
| 600.000 | CREDIT AGRICOLE ITALIA SPA 0.125% 15/03/2033 | EUR | 588.365,94 | 0,26 |
| 601.000 | ERG SPA 0.875% 15/09/2031 EMTN | EUR | 599.729,49 | 0,26 |
| 346.000 | FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 0.875% 07/12/2023 EMTN | EUR | 354.356,10 | 0,15 |
| 190.000 | HERA SPA 0.875% 05/07/2027 EMTN | EUR | 197.002,38 | 0,09 |
| 100.000 | HERA SPA 2.375% 04/07/2024 EMTN | EUR | 106.843,45 | 0,05 |
| 1.010.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 04/12/2024 EMTN | EUR | 1.034.994,62 | 0,45 |
| 1.164.000 | INTESA SANPAOLO SPA 0.750% 16/03/2028 EMTN | EUR | 1.178.430,95 | 0,51 |
| 4.200.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.500% 30/04/2045 | EUR | 4.088.959,27 | 1,76 |
| 1.228.000 | TELECOM ITALIA SPA/MILANO 1.625% 18/01/2029 EMTN | EUR | 1.203.294,84 | 0,52 |
| | | | **11.891.011,91** | **5,16** |
| | **Belgien** | | | |
| 5.160.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.250% 22/04/2033 | EUR | 5.800.855,95 | 2,52 |
| 2.900.000 | KBC GROUP NV 16/06/2027 FRN EMTN | EUR | 2.929.310,07 | 1,27 |
| | | | **8.730.166,02** | **3,79** |
| | **Schweden** | | | |
| 2.000.000 | SBAB BANK AB 0.500% 13/05/2025 EMTN | EUR | 2.047.806,12 | 0,88 |
| 400.000 | SKF AB 0.875% 15/11/2029 EMTN | EUR | 414.737,61 | 0,18 |
| 1.300.000 | SVENSKA HANDELSBANKEN AB 0.010% 02/12/2027 EMTN | EUR | 1.281.734,05 | 0,56 |
| 170.000 | TELIA CO AB 11/05/2081 FRN | EUR | 173.416,53 | 0,08 |
| 500.000 | VATTENFALL AB 0.050% 15/10/2025 EMTN | EUR | 501.741,25 | 0,22 |
| 1.231.000 | VATTENFALL AB 0.125% 12/02/2029 EMTN | EUR | 1.210.077,36 | 0,53 |
| 2.010.000 | VATTENFALL AB 0.500% 24/06/2026 EMTN | EUR | 2.050.286,83 | 0,88 |
| | | | **7.679.799,75** | **3,33** |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 800.000 | APPLE INC ZCP 15/11/2025 | EUR | 806.157,08 | 0,35 |
| 361.000 | APPLE INC 3.000% 20/06/2027 | USD | 340.455,33 | 0,15 |
| 1.309.000 | DIGITAL EURO FINCO LLC 2.500% 16/01/2026 | EUR | 1.429.677,99 | 0,62 |
| 800.000 | EQUINIX INC 1.000% 15/03/2033 | EUR | 795.159,58 | 0,35 |
| 380.000 | PEPSICO INC 2.875% 15/10/2049 | USD | 333.898,89 | 0,14 |
| 861.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.875% 08/02/2029 | USD | 833.805,25 | 0,36 |
| 1.505.000 | VF CORP 0.250% 25/02/2028 | EUR | 1.498.132,59 | 0,65 |
| | | | **6.037.286,71** | **2,62** |
| | **Irland** | | | |
| 4.296.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.350% 18/03/2031 | EUR | 4.813.436,27 | 2,09 |
| 462.000 | SMURFIT KAPPA TREASURY ULC 1.000% 22/09/2033 | EUR | 459.459,62 | 0,20 |
| | | | **5.272.895,89** | **2,29** |
| | **Finnland** | | | |
| 1.580.000 | NORDEA BANK ABP 0.375% 28/05/2026 EMTN | EUR | 1.614.430,41 | 0,70 |
| 1.000.000 | STORA ENSO OYJ 0.625% 02/12/2030 EMTN | EUR | 1.000.565,56 | 0,43 |
| 1.560.000 | UPM-KYMMENE OYJ 0.125% 19/11/2028 EMTN | EUR | 1.533.850,27 | 0,67 |
| | | | **4.148.846,24** | **1,80** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 1.000.000 | EUROFIMA 0.100% 20/05/2030 EMTN | EUR | 995.266,74 | 0,43 |
| 1.740.000 | EUROFIMA 0.150% 10/10/2034 EMTN | EUR | 1.671.273,88 | 0,73 |
| 1.118.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.500% 15/11/2047 | EUR | 1.364.550,67 | 0,59 |
| | | | **4.031.091,29** | **1,75** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 712.000 | HSBC HOLDINGS PLC 04/12/2024 FRN EMTN | EUR | 737.259,47 | 0,32 |
| 2.337.000 | NATIONAL GRID ELECTRICITY TRANSMISSION PLC 0.190% 20/01/2025 | EUR | 2.353.539,49 | 1,02 |
| 655.000 | NATIONAL GRID PLC 0.250% 01/09/2028 EMTN | EUR | 647.852,86 | 0,28 |
| | | | **3.738.651,82** | **1,62** |
| | **Chile** | | | |
| 2.290.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.830% 02/07/2031 | EUR | 2.284.608,17 | 0,99 |
| 840.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.250% 29/01/2040 | EUR | 811.650,00 | 0,35 |
| | | | **3.096.258,17** | **1,34** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 1.400.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 0.875% 09/07/2029 EMTN | EUR | 1.438.393,68 | 0,62 |
| 400.000 | PROLOGIS INTERNATIONAL FUNDING II SA 1.625% 17/06/2032 EMTN | EUR | 429.188,06 | 0,19 |
| 1.210.000 | SEGRO CAPITAL SARL 0.500% 22/09/2031 | EUR | 1.184.247,10 | 0,51 |
| | | | **3.051.828,84** | **1,32** |
| | **Südkorea** | | | |
| 979.000 | KOREA WATER RESOURCES CORP 3.875% 15/05/2023 EMTN | USD | 890.101,16 | 0,39 |
| 1.100.000 | LG CHEM LTD 0.500% 15/04/2023 | EUR | 1.109.121,16 | 0,48 |
| 1.100.000 | SK HYNIX INC 2.375% 19/01/2031 | USD | 922.721,68 | 0,40 |
| | | | **2.921.944,00** | **1,27** |
| | **Ungarn** | | | |
| 2.030.000 | HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.750% 05/06/2035 | EUR | 2.132.071,47 | 0,93 |
| | | | **2.132.071,47** | **0,93** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Green Bond Short Duration

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Österreich** | | | |
| 500.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 0.375% 25/09/2026 EMTN | EUR | 507.357,62 | 0,23 |
| 500.000 | RAIFFEISEN BANK INTERNATIONAL AG 17/06/2033 FRN | EUR | 501.185,65 | 0,22 |
| 400.000 | VERBUND AG 0.900% 01/04/2041 | EUR | 402.108,84 | 0,17 |
| 400.000 | VERBUND AG 1.500% 20/11/2024 | EUR | 422.155,16 | 0,18 |
| | | | **1.832.807,27** | **0,80** |
| | **Norwegen** | | | |
| 1.000.000 | DNB BOLIGKREDITT AS 0.010% 21/01/2031 | EUR | 987.970,22 | 0,43 |
| 440.000 | SPAREBANKEN SOER BOLIGKREDITT AS 0.010% 26/10/2026 | EUR | 443.843,98 | 0,19 |
| | | | **1.431.814,20** | **0,62** |
| | **Tschechische Republik** | | | |
| 1.400.000 | CESKA SPORITELNA AS 13/09/2028 FRN EMTN | EUR | 1.397.382,64 | 0,61 |
| | | | **1.397.382,64** | **0,61** |
| | **Dänemark** | | | |
| 300.000 | KOMMUNEKREDIT 0.625% 21/11/2039 | EUR | 301.974,78 | 0,13 |
| 505.000 | ORSTED AS 1.500% 26/11/2029 | EUR | 550.037,99 | 0,24 |
| 100.000 | ORSTED AS 18/02/3021 FRN | EUR | 99.866,33 | 0,04 |
| | | | **951.879,10** | **0,41** |
| | **Indien** | | | |
| 437.000 | POWER FINANCE CORP LTD 1.841% 21/09/2028 GMTN | EUR | 439.003,74 | 0,19 |
| | | | **439.003,74** | **0,19** |
| | **Litauen** | | | |
| 361.000 | AB IGNITIS GRUPE 2.000% 14/07/2027 EMTN | EUR | 395.440,51 | 0,17 |
| | | | **395.440,51** | **0,17** |
| | **Indonesien** | | | |
| 412.000 | PERUSAHAAN PENERBIT SBSN INDONESIA III 3.750% 01/03/2023 | USD | 371.006,70 | 0,16 |
| | | | **371.006,70** | **0,16** |
| | **Hongkong** | | | |
| 425.000 | MTR CORP LTD 1.625% 19/08/2030 EMTN | USD | 356.661,12 | 0,15 |
| | | | **356.661,12** | **0,15** |
| | **Mexiko** | | | |
| 385.000 | COCA-COLA FEMSA SAB DE CV 1.850% 01/09/2032 | USD | 314.826,68 | 0,14 |
| | | | **314.826,68** | **0,14** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 309.000 | FIBRIA OVERSEAS FINANCE LTD 5.500% 17/01/2027 | USD | 304.940,90 | 0,13 |
| | | | **304.940,90** | **0,13** |
| | **Japan** | | | |
| 214.000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 0.848% 19/07/2029 | EUR | 220.262,44 | 0,10 |
| | | | **220.262,44** | **0,10** |
| | **Portugal** | | | |
| 200.000 | EDP - ENERGIAS DE PORTUGAL SA 1.625% 15/04/2027 EMTN | EUR | 214.365,87 | 0,09 |
| | | | **214.365,87** | **0,09** |
| | | | **222.531.988,27** | **96,56** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **222.531.988,27** | **96,56** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 32.796.778,99 | USD | 27.641.128,13 | EUR | 19/10/2021 | 27.641.128,13 | 649.224,08 |
| 4.179.503,77 | EUR | 3.571.816,04 | GBP | 19/10/2021 | 4.179.503,77 | 25.118,25 |
| 7.435.666,77 | GBP | 8.644.190,81 | EUR | 19/10/2021 | 8.644.190,81 | 4.246,30 |
| 2.281,50 | EUR | 1.967,68 | GBP | 01/10/2021 | 2.281,50 | (7,75) |
| 31.797,65 | EUR | 27.512,92 | GBP | 04/10/2021 | 31.797,65 | (211,54) |
| 5.671.634,11 | EUR | 6.632.000,00 | USD | 29/10/2021 | 5.671.634,11 | (47.998,67) |
| 4.017.442,89 | EUR | 4.716.691,76 | USD | 19/10/2021 | 4.017.442,89 | (51.153,94) |
| | | | | | **50.187.978,86** | **579.216,73** |

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| (437) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 74.211.340,00 | 1.470.070,00 |
| (186) | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 37.821.240,00 | 1.252.540,00 |
| (1) | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 164.858,28 | 4.563,67 |
| (8) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 908.473,19 | 10.354,19 |
| (12) | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 1.503.947,54 | 27.907,43 |
| (5) | US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 949.370,93 | 471,87 |
| (20) | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 2.118.161,92 | 11.324,90 |
| | | | **117.677.391,86** | **2.777.232,06** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **3.356.448,79** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **222.531.988,27** | **96,56** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **3.356.448,79** | **1,46** |
| **Bankguthaben** | **896.077,37** | **0,39** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **3.678.648,18** | **1,59** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **230.463.162,61** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Health Care

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 365.226.506,17 |
| | 30.09.2020 | USD | 308.424.266,32 |
| | 30.09.2019 | USD | 245.740.835,12 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 3.385,40 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.949,74 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.367,42 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 9.627,83 |
| | 30.09.2020 | EUR | 8.434,82 |
| | 30.09.2019 | EUR | 7.010,97 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.089,48 |
| | 30.09.2020 | EUR | 947,54 |
| | 30.09.2019 | EUR | 826,13 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.884,21 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.538,02 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.057,23 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 7.640,21 |
| | 30.09.2020 | CZK | - |
| | 30.09.2019 | CZK | - |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 891,68 |
| | 30.09.2020 | EUR | 788,63 |
| | 30.09.2019 | EUR | 662,66 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 413,05 |
| | 30.09.2020 | EUR | 356,44 |
| | 30.09.2019 | EUR | 308,49 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 368,93 |
| | 30.09.2020 | USD | 322,22 |
| | 30.09.2019 | USD | 259,23 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 349,13 |
| | 30.09.2020 | EUR | 306,68 |
| | 30.09.2019 | EUR | 255,45 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.060,59 |
| | 30.09.2020 | EUR | 927,00 |
| | 30.09.2019 | EUR | 812,28 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.606,25 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.304,91 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.877,63 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 12.360,82 |
| | 30.09.2020 | USD | 10.877,18 |
| | 30.09.2019 | USD | 8.820,03 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 3.849,08 |
| | 30.09.2020 | EUR | 3.403,95 |
| | 30.09.2019 | EUR | 2.858,56 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 363,65 |
| | 30.09.2020 | USD | 318,24 |
| | 30.09.2019 | USD | 256,61 |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 344,02 |
| | 30.09.2020 | EUR | 302,87 |
| | 30.09.2019 | EUR | 252,94 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 7.756 |
| | 30.09.2020 | 5.779 |
| | 30.09.2019 | 3.274 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 4.235 |
| | 30.09.2020 | 3.399 |
| | 30.09.2019 | 3.719 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 19.638 |
| | 30.09.2020 | 11.760 |
| | 30.09.2019 | 8.206 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 23.289 |
| | 30.09.2020 | 24.877 |
| | 30.09.2019 | 26.195 |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 59.203 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 71.773 |
| | 30.09.2020 | 81.919 |
| | 30.09.2019 | 93.013 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1.331 |
| | 30.09.2020 | 1.612 |
| | 30.09.2019 | 118 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 10.218 |
| | 30.09.2020 | 12.795 |
| | 30.09.2019 | 12.890 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 11.359 |
| | 30.09.2020 | 13.645 |
| | 30.09.2019 | 15.847 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 37.830 |
| | 30.09.2020 | 46.056 |
| | 30.09.2019 | 40.108 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 6.211 |
| | 30.09.2020 | 6.577 |
| | 30.09.2019 | 6.046 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 882 |
| | 30.09.2020 | 965 |
| | 30.09.2019 | 1.054 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Health Care

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 4.196 |
| | 30.09.2020 | 4.173 |
| | 30.09.2019 | 4.450 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 2.585 |
| | 30.09.2020 | 3.548 |
| | 30.09.2019 | 4.140 |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 6.612 |
| | 30.09.2020 | 7.270 |
| | 30.09.2019 | 7.971 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 0,65 |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 0,60 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,07% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,07% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 192,96% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Health Care

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **371.862.804,56** |
| Aktien | | 371.862.804,56 |
| **Bankguthaben** | | **3.429.053,17** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **7.771.860,85** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***383.063.718,58*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(14.892.161,98)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(2.945.050,43)** |
| Devisentermingeschäfte | | (2.945.050,43) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(17.837.212,41)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***365.226.506,17*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **4.285.374,46** |
| Dividenden | | 4.285.374,46 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(5.871.230,68)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (4.849.555,29) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (838.536,31) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (32.606,23) |
| Abonnementsteuer | 9 | (148.032,98) |
| Bankzinsen | | (2.499,87) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(1.585.856,22)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 72.581.996,46 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (9.505.434,26) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 51.502,90 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (2.600.927,40) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 980.441,39 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.049.803,24) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (18.726.495,74) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (510.114,19) |
| **Ergebnis** | | **39.635.309,70** |
| Zeichnungen | | 96.015.703,37 |
| Rücknahmen | | (78.841.292,67) |
| Ausschüttung | | (7.480,55) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 308.424.266,32 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***365.226.506,17*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Health Care

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

#### Vereinigte Staaten

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 165.700 | ABBOTT LABORATORIES | USD | 19.574.141,00 | 5,36 |
| 10.200 | ALIGN TECHNOLOGY INC | USD | 6.787.386,00 | 1,86 |
| 1.900 | AMEDISYS INC | USD | 283.290,00 | 0,08 |
| 62.300 | AMGEN INC | USD | 13.248.095,00 | 3,63 |
| 22.643 | ANTHEM INC | USD | 8.441.310,40 | 2,31 |
| 3.000 | APOLLO MEDICAL HOLDINGS INC | USD | 273.150,00 | 0,07 |
| 28.700 | BECTON DICKINSON AND CO | USD | 7.055.034,00 | 1,93 |
| 7.600 | BIOGEN INC | USD | 2.150.724,00 | 0,59 |
| 36.200 | BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | USD | 2.797.898,00 | 0,77 |
| 3.719 | BIO-RAD LABORATORIES INC - A | USD | 2.774.188,05 | 0,76 |
| 27.200 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | USD | 1.180.208,00 | 0,32 |
| 128.700 | CARDINAL HEALTH INC | USD | 6.365.502,00 | 1,74 |
| 2.300 | CENTENE CORP | USD | 143.313,00 | 0,04 |
| 14.800 | CHANGE HEALTHCARE INC | USD | 309.912,00 | 0,08 |
| 18.749 | CIGNA CORP | USD | 3.752.799,84 | 1,03 |
| 11.900 | COVETRUS INC | USD | 215.866,00 | 0,06 |
| 34.700 | DANAHER CORP | USD | 10.564.068,00 | 2,89 |
| 3.800 | DEXCOM INC | USD | 2.078.068,00 | 0,57 |
| 50.400 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 5.705.784,00 | 1,56 |
| 92.464 | ELI LILLY & CO | USD | 21.363.807,20 | 5,85 |
| 16.200 | EXELIXIS INC | USD | 342.468,00 | 0,09 |
| 28.300 | HCA HEALTHCARE INC | USD | 6.868.976,00 | 1,88 |
| 114.700 | HOLOGIC INC | USD | 8.466.007,00 | 2,32 |
| 13.900 | IDEXX LABORATORIES INC | USD | 8.644.410,00 | 2,37 |
| 51.200 | INCYTE CORP | USD | 3.521.536,00 | 0,96 |
| 113.225 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 18.285.837,50 | 5,01 |
| 297.613 | MERCK & CO INC | USD | 22.353.712,43 | 6,12 |
| 10.420 | METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | USD | 14.352.091,20 | 3,93 |
| 19.800 | MODERNA INC | USD | 7.620.228,00 | 2,09 |
| 54.200 | MULTIPLAN CORP | USD | 305.146,00 | 0,08 |
| 13.600 | OPTION CARE HEALTH INC | USD | 329.936,00 | 0,09 |
| 8.921 | ORGANON & CO | USD | 292.519,59 | 0,08 |
| 50.300 | PERKINELMER INC | USD | 8.716.487,00 | 2,39 |
| 5.200 | PROGYNY INC | USD | 291.200,00 | 0,08 |
| 46.500 | QUEST DIAGNOSTICS INC | USD | 6.756.915,00 | 1,85 |
| 2.500 | QUIDEL CORP | USD | 352.875,00 | 0,10 |
| 13.600 | REGENERON PHARMACEUTICALS INC | USD | 8.230.448,00 | 2,25 |
| 13.700 | R1 RCM INC | USD | 301.537,00 | 0,08 |
| 4.800 | TENET HEALTHCARE CORP | USD | 318.912,00 | 0,09 |
| 10.717 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 6.122.943,61 | 1,68 |
| 34.883 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 13.630.183,42 | 3,73 |
| 7.100 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 1.287.869,00 | 0,35 |
| | | | **252.456.782,24** | **69,12** |

#### Schweiz

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 400 | BACHEM HOLDING AG - REG | CHF | 306.587,34 | 0,08 |
| 4.000 | GALENICA AG | CHF | 282.574,90 | 0,08 |
| 14.288 | NOVARTIS AG - REG | CHF | 1.176.766,94 | 0,32 |
| 67.508 | ROCHE HOLDING AG - GENUSSCHEIN | CHF | 24.746.058,42 | 6,78 |
| 7.872 | SONOVA HOLDING AG - REG | CHF | 2.997.410,52 | 0,82 |
| 1.826 | STRAUMANN HOLDING AG - REG | CHF | 3.295.354,02 | 0,90 |
| 548 | TECAN GROUP AG | CHF | 312.228,12 | 0,09 |
| | | | **33.116.980,26** | **9,07** |

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|

#### Japan

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 300.900 | CHUGAI PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 11.032.196,44 | 3,02 |
| 32.700 | M3 INC | JPY | 2.335.293,71 | 0,64 |
| 100.500 | OTSUKA HOLDINGS CO LTD | JPY | 4.299.003,23 | 1,18 |
| 42.700 | PEPTIDREAM INC | JPY | 1.388.889,01 | 0,38 |
| 81.500 | SUMITOMO DAINIPPON PHARMA CO LTD | JPY | 1.455.095,08 | 0,40 |
| 4.600 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 152.047,90 | 0,04 |
| | | | **20.662.525,37** | **5,66** |

#### Vereinigtes Königreich

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 5.000 | ASTRAZENECA PLC | SEK | 603.414,28 | 0,17 |
| 118.962 | ASTRAZENECA PLC | GBP | 14.368.847,64 | 3,93 |
| 4.400 | GENUS PLC | GBP | 0,00 | 0,00 |
| 217.200 | GLAXOSMITHKLINE PLC | GBP | 4.110.605,56 | 1,14 |
| 12.800 | ORTHO CLINICAL DIAGNOSTICS HOLDINGS PLC | USD | 236.544,00 | 0,06 |
| 23.600 | ROYALTY PHARMA PLC - A | USD | 852.904,00 | 0,23 |
| | | | **20.172.315,48** | **5,53** |

#### Dänemark

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 14.300 | AMBU AS - B | DKK | 423.131,65 | 0,12 |
| 900 | COLOPLAST AS - B | DKK | 141.183,90 | 0,04 |
| 700 | GENMAB AS | DKK | 306.463,43 | 0,08 |
| 122.404 | NOVO NORDISK AS - B | DKK | 11.854.841,04 | 3,24 |
| | | | **12.725.620,02** | **3,48** |

#### Deutschland

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 8.800 | BAYER AG | EUR | 479.392,71 | 0,13 |
| 4.000 | COMPUGROUP MEDICAL SE & CO KGAA | EUR | 329.605,37 | 0,09 |
| 6.900 | FRESENIUS MEDICAL CARE AG & CO KGAA | EUR | 486.682,50 | 0,13 |
| 10.200 | FRESENIUS SE & CO KGAA | EUR | 490.997,27 | 0,14 |
| 2.877 | MERCK KGAA | EUR | 625.681,23 | 0,17 |
| 8.400 | SARTORIUS AG | EUR | 5.352.401,87 | 1,47 |
| | | | **7.764.760,95** | **2,13** |

#### Luxemburg

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 47.900 | EUROFINS SCIENTIFIC SE | EUR | 6.153.138,96 | 1,68 |
| | | | **6.153.138,96** | **1,68** |

#### Frankreich

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 16.700 | IPSEN SA | EUR | 1.597.904,60 | 0,44 |
| 7.000 | SARTORIUS STEDIM BIOTECH | EUR | 3.924.088,74 | 1,07 |
| | | | **5.521.993,34** | **1,51** |

#### Australien

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 16.200 | COCHLEAR LTD | AUD | 2.571.458,03 | 0,70 |
| 7.400 | PRO MEDICUS LTD | AUD | 291.042,71 | 0,08 |
| 13.600 | RAMSAY HEALTH CARE LTD | AUD | 681.907,96 | 0,19 |
| 18.500 | SONIC HEALTHCARE LTD | AUD | 541.741,29 | 0,15 |
| | | | **4.086.149,99** | **1,12** |

#### Jersey

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 32.100 | NOVOCURE LTD | USD | 3.729.057,00 | 1,02 |
| | | | **3.729.057,00** | **1,02** |

#### Irland

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1.281 | ICON PLC - ADR | USD | 335.647,62 | 0,09 |
| 20.368 | MEDTRONIC PLC | USD | 2.553.128,80 | 0,70 |
| | | | **2.888.776,42** | **0,79** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Health Care

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Finnland** | | | |
| 47.100 | ORION OYJ - B | EUR | 1.869.589,13 | 0,51 |
| | | | **1.869.589,13** | **0,51** |
| | **Israel** | | | |
| 1.800 | INMODE LTD | USD | 287.010,00 | 0,08 |
| | | | **287.010,00** | **0,08** |
| | **Schweden** | | | |
| 5.400 | VITROLIFE AB | SEK | 285.043,81 | 0,08 |
| | | | **285.043,81** | **0,08** |
| | **Neuseeland** | | | |
| 6.500 | FISHER & PAYKEL HEALTHCARE CORP LTD | NZD | 143.061,59 | 0,04 |
| | | | **143.061,59** | **0,04** |
| | | | **371.862.804,56** | **101,82** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **371.862.804,56** | **101,82** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | Zu zahlen | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | |
| 4.069.446,78 USD | 3.491.382,28 EUR | 19/10/2021 | 4.069.446,78 | 21.913,14 |
| 6.607.254,07 EUR | 5.668.907,18 GBP | 19/10/2021 | 7.802.597,80 | 15.923,41 |
| 161.722.118,00 JPY | 1.245.413,61 EUR | 19/10/2021 | 1.468.662,36 | 5.801,62 |
| 7.654.668,44 EUR | 56.901.153,99 DKK | 19/10/2021 | 9.035.953,22 | 3.068,82 |
| 1.521.220,67 EUR | 2.439.734,03 AUD | 19/10/2021 | 1.797.266,46 | 1.085,38 |
| 1.555.787,37 SEK | 152.767,87 EUR | 19/10/2021 | 180.643,66 | 750,92 |
| 146.173,66 AUD | 90.450,34 EUR | 19/10/2021 | 105.778,56 | 736,90 |
| 887.452,39 EUR | 1.490.416,98 NZD | 19/10/2021 | 1.047.617,98 | 733,35 |
| 22.214,29 CHF | 20.517,87 EUR | 19/10/2021 | 23.919,77 | 36,34 |
| 4.807,15 USD | 105.056,34 CZK | 01/10/2021 | 4.807,15 | 2,86 |
| 111.937,96 CZK | 4.415,33 EUR | 19/10/2021 | 5.221,39 | (2,42) |
| 23.904.763,23 DKK | 3.214.865,01 EUR | 19/10/2021 | 3.801.079,14 | (199,09) |
| 66.475,71 USD | 1.459.281,43 CZK | 04/10/2021 | 66.475,71 | (258,09) |
| 179.739,91 EUR | 4.571.666,91 CZK | 19/10/2021 | 212.173,98 | (581,68) |
| 269.222,08 GBP | 315.130,95 EUR | 19/10/2021 | 370.868,75 | (2.316,43) |
| 461.417,87 EUR | 4.707.592,33 SEK | 19/10/2021 | 544.680,73 | (3.241,44) |
| 1.404.490,73 NZD | 845.571,94 EUR | 19/10/2021 | 995.550,80 | (11.453,21) |
| 10.294.978,70 EUR | 11.161.872,84 CHF | 19/10/2021 | 12.157.068,18 | (35.072,57) |
| 8.723.954,49 EUR | 1.137.566.862,00 JPY | 19/10/2021 | 10.302.054,49 | (82.994,37) |
| 473.748.098,26 CZK | 22.100.285,41 USD | 19/10/2021 | 22.100.285,41 | (447.132,50) |
| 95.156.843,88 EUR | 112.726.476,29 USD | 19/10/2021 | 112.726.476,29 | (2.411.851,37) |
| | | | **188.818.628,61** | **(2.945.050,43)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(2.945.050,43)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **371.862.804,56** | **101,82** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(2.945.050,43)** | **(0,81)** |
| **Bankguthaben** | **3.429.053,17** | **0,94** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(7.120.301,13)** | **(1,95)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **365.226.506,17** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Health & Well-being

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 324.440.268,89 |
| | 30.09.2020 | EUR | 98.254.092,93 |
| | 30.09.2019 | EUR | 109.763.461,90 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 13.030,87 |
| | 30.09.2020 | EUR | 10.365,91 |
| | 30.09.2019 | EUR | 9.851,90 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.242,13 |
| | 30.09.2020 | EUR | 997,90 |
| | 30.09.2019 | EUR | 957,95 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 268,94 |
| | 30.09.2020 | USD | 218,61 |
| | 30.09.2019 | USD | 195,11 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 366,50 |
| | 30.09.2020 | EUR | 292,25 |
| | 30.09.2019 | EUR | 278,45 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 327,73 |
| | 30.09.2020 | USD | 264,42 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.118,83 |
| | 30.09.2020 | EUR | 903,35 |
| | 30.09.2019 | EUR | 871,50 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 228,10 |
| | 30.09.2020 | USD | 186,35 |
| | 30.09.2019 | USD | 167,14 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 61,32 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution O (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 12.291,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.472,84 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.396,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 4.222,46 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 323,30 |
| | 30.09.2020 | USD | 262,80 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 359,37 |
| | 30.09.2020 | EUR | 286,56 |
| | 30.09.2019 | EUR | 274,53 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 327,73 |
| | 30.09.2020 | USD | 264,42 |
| | 30.09.2019 | USD | - |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 653 |
| | 30.09.2020 | 90 |
| | 30.09.2019 | 2.981 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 28.777 |
| | 30.09.2020 | 33.633 |
| | 30.09.2019 | 26.144 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 61.116 |
| | 30.09.2020 | 80.806 |
| | 30.09.2019 | 774 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 9.964 |
| | 30.09.2020 | 6.033 |
| | 30.09.2019 | 7.004 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 656 |
| | 30.09.2020 | 656 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 33.114 |
| | 30.09.2020 | 36.580 |
| | 30.09.2019 | 50.499 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 21.424 |
| | 30.09.2020 | 24.319 |
| | 30.09.2019 | 27.966 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 3.392.492 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution O (EUR) | 30.09.2021 | 290 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 709 |
| | 30.09.2020 | 888 |
| | 30.09.2019 | 1.112 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 17.649 |
| | 30.09.2020 | 24.851 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 574 |
| | 30.09.2020 | 574 |
| | 30.09.2019 | 977 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1.051 |
| | 30.09.2020 | 1.052 |
| | 30.09.2019 | - |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Health & Well-being

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Distribution O (EUR) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 25,53% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Health & Well-being

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **311.983.853,50** |
| Aktien | | 311.983.853,50 |
| **Bankguthaben** | | **10.752.994,93** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **6.316.689,31** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***329.053.537,74*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(4.613.268,85)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(4.613.268,85)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***324.440.268,89*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **2.545.613,86** |
| Dividenden | | 2.438.523,86 |
| Sonstige Erträge | 10 | 107.090,00 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(3.646.080,57)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.813.526,88) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (646.380,65) |
| Abonnementsteuer | 9 | (151.211,92) |
| Bankzinsen | | (34.961,12) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(1.100.466,71)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 15.141.438,41 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (4.552.937,12) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 1.300.671,41 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.379.487,36) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 53.370.478,85 |
| **Ergebnis** | | **62.779.697,48** |
| Zeichnungen | | 230.317.703,72 |
| Rücknahmen | | (66.911.225,24) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 98.254.092,93 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***324.440.268,89*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Health & Well-being

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| | **Vereinigte Staaten** | | | |
| 105.000 | ABBOTT LABORATORIES | USD | 10.702.489,32 | 3,30 |
| 94.000 | AMERICAN WATER WORKS CO INC | USD | 13.710.479,31 | 4,23 |
| 24.000 | ANTHEM INC | USD | 7.720.091,46 | 2,38 |
| 62.000 | DANAHER CORP | USD | 16.286.535,23 | 5,02 |
| 145.000 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 14.164.070,93 | 4,37 |
| 156.000 | HOLOGIC INC | USD | 9.935.165,45 | 3,06 |
| 20.000 | ILLUMINA INC | USD | 6.999.611,72 | 2,16 |
| 36.500 | MASTERCARD INC - A | USD | 10.949.842,53 | 3,37 |
| 35.500 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 17.500.509,08 | 5,39 |
| 46.000 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 15.508.900,30 | 4,78 |
| 45.900 | VEEVA SYSTEMS INC - A | USD | 11.412.919,45 | 3,52 |
| 55.000 | VISA INC - A | USD | 10.570.990,98 | 3,26 |
| 55.000 | XYLEM INC/NY | USD | 5.869.450,80 | 1,81 |
| 22.300 | ZOETIS INC - A | USD | 3.735.555,46 | 1,15 |
| | | | **155.066.612,02** | **47,80** |
| | **Indien** | | | |
| 800.000 | BANDHAN BANK LTD | INR | 2.621.610,93 | 0,81 |
| 450.000 | DABUR INDIA LTD | INR | 3.221.817,29 | 0,99 |
| 460.000 | HOUSING DEVELOPMENT FINANCE CORP LTD | INR | 14.634.430,28 | 4,51 |
| | | | **20.477.858,50** | **6,31** |
| | **Dänemark** | | | |
| 58.000 | CHR HANSEN HOLDING AS | DKK | 4.090.297,00 | 1,26 |
| 171.000 | NOVO NORDISK AS - B | DKK | 14.289.976,89 | 4,41 |
| | | | **18.380.273,89** | **5,67** |
| | **Japan** | | | |
| 139.000 | RECRUIT HOLDINGS CO LTD | JPY | 7.322.109,72 | 2,26 |
| 284.000 | SMS CO LTD | JPY | 8.945.074,77 | 2,75 |
| | | | **16.267.184,49** | **5,01** |
| | **Färöer-Inseln** | | | |
| 197.000 | BAKKAFROST P/F | NOK | 14.098.182,97 | 4,35 |
| | | | **14.098.182,97** | **4,35** |
| | **Hongkong** | | | |
| 1.350.000 | AIA GROUP LTD | HKD | 13.419.499,58 | 4,14 |
| | | | **13.419.499,58** | **4,14** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 5.700.000 | HELIOS TOWERS PLC | GBP | 12.003.042,53 | 3,69 |
| | | | **12.003.042,53** | **3,69** |
| | **Irland** | | | |
| 53.000 | ICON PLC - ADR | USD | 11.982.449,63 | 3,69 |
| | | | **11.982.449,63** | **3,69** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 210.000 | ARCO PLATFORM LTD - A | USD | 3.932.007,42 | 1,21 |
| 146.600 | PAGSEGURO DIGITAL LTD - A | USD | 6.542.259,80 | 2,02 |
| | | | **10.474.267,22** | **3,23** |
| | **Schweiz** | | | |
| 6.400 | STRAUMANN HOLDING AG - REG | CHF | 9.965.901,03 | 3,07 |
| | | | **9.965.901,03** | **3,07** |
| | **Niederlande** | | | |
| 47.000 | KONINKLIJKE DSM NV | EUR | 8.119.250,00 | 2,50 |
| | | | **8.119.250,00** | **2,50** |
| | **Norwegen** | | | |
| 140.000 | SALMAR ASA | NOK | 8.048.422,82 | 2,48 |
| | | | **8.048.422,82** | **2,48** |
| | **Deutschland** | | | |
| 82.000 | HELLOFRESH SE | EUR | 6.556.720,00 | 2,02 |
| | | | **6.556.720,00** | **2,02** |
| | **Kenia** | | | |
| 11.000.000 | SAFARICOM PLC | KES | 3.650.518,78 | 1,13 |
| | | | **3.650.518,78** | **1,13** |
| | **Schweden** | | | |
| 40.000 | MIPS AB | SEK | 3.473.670,04 | 1,07 |
| | | | **3.473.670,04** | **1,07** |
| | | | **311.983.853,50** | **96,16** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **311.983.853,50** | **96,16** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **311.983.853,50** | **96,16** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **0,00** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **10.752.994,93** | **3,31** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **1.703.420,46** | **0,53** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **324.440.268,89** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Japan Equity

*(ausgedrückt in JPY)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | JPY | 14.718.206.817,35 |
| | 30.09.2020 | JPY | 19.403.983.805,00 |
| | 30.09.2019 | JPY | 23.260.466.670,00 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 54,58 |
| | 30.09.2020 | EUR | 41,95 |
| | 30.09.2019 | EUR | 46,39 |
| Capitalisation I (JPY) | 30.09.2021 | JPY | 7.015,00 |
| | 30.09.2020 | JPY | 5.160,00 |
| | 30.09.2019 | JPY | 5.434,00 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 62.625,61 |
| | 30.09.2020 | PLN | 46.151,55 |
| | 30.09.2019 | PLN | 48.880,37 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 321,76 |
| | 30.09.2020 | EUR | 249,24 |
| | 30.09.2019 | EUR | 277,86 |
| Capitalisation P (JPY) | 30.09.2021 | JPY | 6.084,00 |
| | 30.09.2020 | JPY | 4.510,00 |
| | 30.09.2019 | JPY | 4.787,00 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 294,35 |
| | 30.09.2020 | EUR | 226,53 |
| | 30.09.2019 | EUR | 250,90 |
| Capitalisation R (JPY) | 30.09.2021 | JPY | 5.598,00 |
| | 30.09.2020 | JPY | 4.123,00 |
| | 30.09.2019 | JPY | 4.348,00 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 186,99 |
| | 30.09.2020 | EUR | 144,72 |
| | 30.09.2019 | EUR | 161,19 |
| Capitalisation X (JPY) | 30.09.2021 | JPY | 5.448,00 |
| | 30.09.2020 | JPY | 4.059,00 |
| | 30.09.2019 | JPY | 4.330,00 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 155,01 |
| | 30.09.2020 | USD | 122,10 |
| | 30.09.2019 | USD | 127,16 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 13.981,87 |
| | 30.09.2020 | CZK | 10.450,76 |
| | 30.09.2019 | CZK | 11.346,23 |
| Capitalisation X Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 306,23 |
| | 30.09.2020 | USD | 227,56 |
| | 30.09.2019 | USD | 240,35 |
| Capitalisation Y Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | USD | 287,47 |
| | 30.09.2020 | USD | 215,38 |
| | 30.09.2019 | USD | 229,60 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 10.725,11 |
| | 30.09.2020 | EUR | 8.183,09 |
| | 30.09.2019 | EUR | 8.986,00 |
| Distribution P (JPY) | 30.09.2021 | JPY | 5.360,00 |
| | 30.09.2020 | JPY | 3.996,00 |
| | 30.09.2019 | JPY | 4.273,00 |
| Distribution R (JPY) | 30.09.2021 | JPY | 5.408,00 |
| | 30.09.2020 | JPY | 4.029,00 |
| | 30.09.2019 | JPY | 4.306,00 |

| **Anzahl der Anteile** | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 5.335 |
| | 30.09.2020 | 30.637 |
| | 30.09.2019 | 56.837 |
| Capitalisation I (JPY) | 30.09.2021 | 632.060 |
| | 30.09.2020 | 726.809 |
| | 30.09.2019 | 824.609 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 1.938 |
| | 30.09.2020 | 2.420 |
| | 30.09.2019 | 2.871 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 2.492 |
| | 30.09.2020 | 3.490 |
| | 30.09.2019 | 4.566 |
| Capitalisation P (JPY) | 30.09.2021 | 473.570 |
| | 30.09.2020 | 535.218 |
| | 30.09.2019 | 614.812 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 117 |
| | 30.09.2020 | 197 |
| | 30.09.2019 | 331 |
| Capitalisation R (JPY) | 30.09.2021 | 28.394 |
| | 30.09.2020 | 29.677 |
| | 30.09.2019 | 30.728 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 1.077 |
| | 30.09.2020 | 1.973 |
| | 30.09.2019 | 3.527 |
| Capitalisation X (JPY) | 30.09.2021 | 170.391 |
| | 30.09.2020 | 180.493 |
| | 30.09.2019 | 190.753 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2.766 |
| | 30.09.2020 | 1.321 |
| | 30.09.2019 | 4.165 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 5.765 |
| | 30.09.2020 | 6.390 |
| | 30.09.2019 | 7.270 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Japan Equity

*(ausgedrückt in JPY)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation X Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 287 |
| | 30.09.2020 | 522 |
| | 30.09.2019 | 337 |
| Capitalisation Y Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 796 |
| | 30.09.2020 | 855 |
| | 30.09.2019 | 1.049 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 1.328 |
| | 30.09.2020 | 8.223 |
| | 30.09.2019 | 9.126 |
| Distribution P (JPY) | 30.09.2021 | 56.783 |
| | 30.09.2020 | 70.131 |
| | 30.09.2019 | 79.486 |
| Distribution R (JPY) | 30.09.2021 | 17.382 |
| | 30.09.2020 | 16.791 |
| | 30.09.2019 | 20.122 |

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution P (JPY) | 14.12.2020 | JPY | 25,00 |
| Distribution R (JPY) | 14.12.2020 | JPY | 52,00 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I (JPY) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation P (JPY) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation R (JPY) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 1,51% |
| Capitalisation X (JPY) | 30.09.2021 | 2,10% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,10% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,12% |
| Capitalisation X Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 2,12% |
| Capitalisation Y Hedged (i) (USD) | 30.09.2021 | 3,11% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,09% |
| Distribution P (JPY) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Distribution R (JPY) | 30.09.2021 | 0,95% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 43,60% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Japan Equity

*(ausgedrückt in JPY)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **14.471.701.491,00** |
| Aktien | | 14.471.701.491,00 |
| **Bankguthaben** | | **262.937.686,00** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **1.923.112.923,31** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***16.657.752.100,31*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(1.834.529.151,65)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(105.016.131,31)** |
| Devisentermingeschäfte | | (105.016.131,31) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(1.939.545.282,96)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***14.718.206.817,35*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **466.947.215,00** |
| Dividenden | | 466.947.215,00 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(158.572.407,00)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (116.763.590,00) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (36.153.869,00) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (781.149,00) |
| Abonnementsteuer | 9 | (4.215.341,00) |
| Bankzinsen | | (658.458,00) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **308.374.808,00** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 4.708.827.708,01 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (361.939.847,47) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 20.754.883,31 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (24.958,00) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 84.974.032,00 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (90.284.138,00) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 2.417.655.985,00 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 92.550.264,15 |
| **Ergebnis** | | **7.180.888.737,00** |
| Zeichnungen | | 8.133.880.733,00 |
| Rücknahmen | | (19.997.959.593,65) |
| Ausschüttung | | (2.586.864,00) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 19.403.983.805,00 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***14.718.206.817,35*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Japan Equity

*(ausgedrückt in JPY)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in JPY | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Japan** | | | | |
| 34.700 | ADEKA CORP | JPY | 87.495.049,00 | 0,59 |
| 45.000 | AISIN CORP | JPY | 182.604.762,00 | 1,24 |
| 11.200 | ALPEN CO LTD | JPY | 34.728.305,00 | 0,24 |
| 32.400 | ARCLAND SAKAMOTO CO LTD | JPY | 56.401.990,00 | 0,38 |
| 26.000 | BANDAI NAMCO HOLDINGS INC | JPY | 217.749.823,00 | 1,48 |
| 13.400 | BANK OF KYOTO LTD/THE | JPY | 68.938.158,00 | 0,47 |
| 21.300 | CHUBU STEEL PLATE CO LTD | JPY | 17.520.187,00 | 0,12 |
| 51.300 | CITIZEN HOLDINGS CO LTD | JPY | 26.391.996,00 | 0,18 |
| 159.100 | DAI-ICHI LIFE HOLDINGS INC | JPY | 392.282.987,00 | 2,67 |
| 80.900 | DAIICHI SANKYO CO LTD | JPY | 240.323.969,00 | 1,63 |
| 81.200 | DAIWA HOUSE INDUSTRY CO LTD | JPY | 302.702.963,00 | 2,06 |
| 34.600 | DENSO CORP | JPY | 253.380.434,00 | 1,72 |
| 54.700 | DENTSU GROUP INC | JPY | 234.782.466,00 | 1,60 |
| 434.000 | ENEOS HOLDINGS INC | JPY | 197.271.569,00 | 1,34 |
| 10.400 | EXEDY CORP | JPY | 17.762.164,00 | 0,12 |
| 42.100 | FCC CO LTD | JPY | 66.236.027,00 | 0,45 |
| 31.300 | FUJI MEDIA HOLDINGS INC | JPY | 36.980.082,00 | 0,25 |
| 57.500 | FUJIFILM HOLDINGS CORP | JPY | 552.592.520,00 | 3,75 |
| 16.200 | FURUKAWA CO LTD | JPY | 19.818.225,00 | 0,13 |
| 11.400 | GOLDCREST CO LTD | JPY | 19.242.743,00 | 0,13 |
| 25.200 | GS YUASA CORP | JPY | 63.867.698,00 | 0,43 |
| 7.100 | GUNZE LTD | JPY | 30.934.633,00 | 0,21 |
| 10.500 | HAMAKYOREX CO LTD | JPY | 35.332.003,00 | 0,24 |
| 137.300 | HASEKO CORP | JPY | 205.473.778,00 | 1,40 |
| 81.800 | HITACHI LTD | JPY | 541.535.036,00 | 3,68 |
| 15.600 | HOKKOKU BANK LTD/THE | JPY | 34.357.811,00 | 0,23 |
| 99.000 | HONDA MOTOR CO LTD | JPY | 341.026.732,00 | 2,32 |
| 40.700 | IHI CORP | JPY | 116.501.838,00 | 0,79 |
| 212.900 | INPEX CORP | JPY | 185.945.188,00 | 1,26 |
| 219.900 | ISETAN MITSUKOSHI HOLDINGS LTD | JPY | 185.481.573,00 | 1,26 |
| 86.700 | ITOCHU CORP | JPY | 283.270.087,00 | 1,92 |
| 11.900 | ITOKI CORP | JPY | 4.615.319,00 | 0,03 |
| 6.800 | KATO WORKS CO LTD | JPY | 5.939.067,00 | 0,04 |
| 7.900 | KISSEI PHARMACEUTICAL CO LTD | JPY | 18.950.815,00 | 0,13 |
| 7.200 | KI-STAR REAL ESTATE CO LTD | JPY | 40.846.038,00 | 0,28 |
| 11.800 | KOHNAN SHOJI CO LTD | JPY | 43.412.375,00 | 0,29 |
| 92.200 | KOMATSU LTD | JPY | 247.739.278,00 | 1,68 |
| 89.600 | KONICA MINOLTA INC | JPY | 53.957.290,00 | 0,37 |
| 12.400 | KONOIKE TRANSPORT CO LTD | JPY | 15.849.475,00 | 0,11 |
| 154.900 | K'S HOLDINGS CORP | JPY | 178.994.642,00 | 1,22 |
| 108.100 | KUBOTA CORP | JPY | 257.482.087,00 | 1,75 |
| 10.300 | KYOCERA CORP | JPY | 71.885.358,00 | 0,49 |
| 26.500 | KYUSHU ELECTRIC POWER CO INC | JPY | 22.431.522,00 | 0,15 |
| 19.100 | MABUCHI MOTOR CO LTD | JPY | 73.887.380,00 | 0,50 |
| 231.800 | MARUBENI CORP | JPY | 215.671.788,00 | 1,47 |
| 53.000 | MATSUYA CO LTD | JPY | 60.662.867,00 | 0,41 |
| 261.400 | MEBUKI FINANCIAL GROUP INC | JPY | 64.112.966,00 | 0,44 |
| 210.900 | MITSUBISHI CHEMICAL HOLDINGS CORP | JPY | 215.213.546,00 | 1,46 |
| 95.000 | MITSUBISHI CORP | JPY | 334.919.966,00 | 2,28 |
| 229.700 | MITSUBISHI ESTATE CO LTD | JPY | 407.763.314,00 | 2,77 |
| 42.800 | MITSUBISHI GAS CHEMICAL CO INC | JPY | 94.519.774,00 | 0,64 |
| 30.200 | MITSUBISHI HEAVY INDUSTRIES LTD | JPY | 91.052.926,00 | 0,62 |
| 230.320 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC | JPY | 151.076.431,00 | 1,03 |
| 104.000 | MITSUI & CO LTD | JPY | 255.493.126,00 | 1,74 |
| 63.500 | MITSUI FUDOSAN CO LTD | JPY | 168.881.987,00 | 1,15 |
| 10.000 | MIZUHO LEASING CO LTD | JPY | 36.291.637,00 | 0,25 |
| 32.300 | NAMURA SHIPBUILDING CO LTD | JPY | 7.696.718,00 | 0,05 |
| 26.500 | NEC CORP | JPY | 160.376.135,00 | 1,09 |
| 85.100 | NGK INSULATORS LTD | JPY | 161.463.189,00 | 1,10 |
| 20.500 | NGK SPARK PLUG CO LTD | JPY | 35.809.078,00 | 0,24 |
| 22.900 | NICHIHA CORP | JPY | 73.061.845,00 | 0,50 |
| 11.700 | NIHON UNISYS LTD | JPY | 34.003.968,00 | 0,23 |
| 1.700 | NINTENDO CO LTD | JPY | 92.052.143,00 | 0,63 |
| 182.700 | NIPPON TELEGRAPH & TELEPHONE CORP | JPY | 561.951.575,00 | 3,82 |
| 12.800 | NIPPON YUSEN KK | JPY | 107.838.008,00 | 0,73 |
| 31.000 | NISSHINBO HOLDINGS INC | JPY | 26.209.741,00 | 0,18 |
| 16.600 | NITTO DENKO CORP | JPY | 132.073.643,00 | 0,90 |
| 21.200 | NOK CORP | JPY | 27.837.281,00 | 0,19 |
| 20.500 | OSAKA STEEL CO LTD | JPY | 22.748.575,00 | 0,15 |
| 45.000 | OTSUKA HOLDINGS CO LTD | JPY | 214.773.710,00 | 1,46 |
| 19.000 | ROHM CO LTD | JPY | 201.558.170,00 | 1,37 |
| 19.500 | SANYO SPECIAL STEEL CO LTD | JPY | 34.995.507,00 | 0,24 |
| 5.100 | SAWAI GROUP HOLDINGS CO LTD | JPY | 26.441.050,00 | 0,18 |
| 30.800 | SBI HOLDINGS INC/JAPAN | JPY | 84.785.639,00 | 0,58 |
| 77.600 | SEINO HOLDINGS CO LTD | JPY | 105.144.450,00 | 0,71 |
| 42.800 | SEVEN & I HOLDINGS CO LTD | JPY | 216.990.092,00 | 1,47 |
| 134.300 | SHIMIZU CORP | JPY | 112.877.859,00 | 0,77 |
| 23.600 | SHIN-ETSU CHEMICAL CO LTD | JPY | 444.712.139,00 | 3,02 |
| 52.700 | SHINKO ELECTRIC INDUSTRIES CO LTD | JPY | 196.511.239,00 | 1,34 |
| 21.600 | SOMPO HOLDINGS INC | JPY | 105.115.736,00 | 0,71 |
| 55.100 | STARTS CORP INC | JPY | 146.404.353,00 | 0,99 |
| 107.500 | SUMCO CORP | JPY | 241.262.118,00 | 1,64 |
| 29.900 | SUMITOMO METAL MINING CO LTD | JPY | 121.181.665,00 | 0,82 |
| 72.500 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC | JPY | 285.088.757,00 | 1,94 |
| 36.900 | SUMITOMO MITSUI TRUST HOLDINGS INC | JPY | 141.899.604,00 | 0,96 |
| 5.500 | SUN-WA TECHNOS CORP | JPY | 7.973.193,00 | 0,05 |
| 92.000 | TADANO LTD | JPY | 108.603.721,00 | 0,74 |
| 23.800 | TAIYO YUDEN CO LTD | JPY | 156.849.664,00 | 1,07 |
| 23.700 | TAKARA HOLDINGS INC | JPY | 38.256.072,00 | 0,26 |
| 35.200 | TBS HOLDINGS INC | JPY | 60.188.284,00 | 0,41 |
| 140.300 | T&D HOLDINGS INC | JPY | 216.677.724,00 | 1,47 |
| 74.700 | TDK CORP | JPY | 301.261.965,00 | 2,05 |
| 133.800 | TOKAI CARBON CO LTD | JPY | 192.231.817,00 | 1,31 |
| 71.300 | TOKIO MARINE HOLDINGS INC | JPY | 428.019.282,00 | 2,91 |
| 23.400 | TOKYO SEIMITSU CO LTD | JPY | 107.669.511,00 | 0,73 |
| 30.700 | TOYOTA INDUSTRIES CORP | JPY | 281.599.176,00 | 1,91 |
| 2.300 | TSUTSUMI JEWELRY CO LTD | JPY | 4.953.210,00 | 0,03 |
| 12.100 | WACOAL HOLDINGS CORP | JPY | 28.627.821,00 | 0,19 |
| 28.600 | WEST JAPAN RAILWAY CO | JPY | 160.966.372,00 | 1,09 |
| 3.500 | YODOGAWA STEEL WORKS LTD | JPY | 8.528.535,00 | 0,06 |
| 41.800 | ZEON CORP | JPY | 65.847.387,00 | 0,45 |
| | | | **14.471.701.491,00** | **98,33** |
| | | | **14.471.701.491,00** | **98,33** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **14.471.701.491,00** | **98,33** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Japan Equity

*(ausgedrückt in JPY)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in JPY | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in JPY |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 175.192.068,00 | JPY | 6.135.959,29 | PLN | 19/10/2021 | 175.192.068,00 | 2.819.135,00 |
| 923.061,92 | USD | 101.517.933,00 | JPY | 19/10/2021 | 101.517.933,00 | 1.456.400,00 |
| 8.956.988,00 | JPY | 1.767.338,28 | CZK | 19/10/2021 | 8.956.988,00 | (54.848,00) |
| 66.102.190,00 | JPY | 602.377,14 | USD | 19/10/2021 | 66.102.190,00 | (1.097.402,00) |
| 81.778.053,00 | CZK | 419.803.094,00 | JPY | 19/10/2021 | 419.803.094,00 | (2.808.540,00) |
| 130.382.189,58 | PLN | 3.768.060.589,00 | JPY | 19/10/2021 | 3.768.060.589,00 | (105.330.876,31) |
| | | | | | **4.539.632.862,00** | **(105.016.131,31)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(105.016.131,31)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **14.471.701.491,00** | **98,33** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(105.016.131,31)** | **(0,71)** |
| **Bankguthaben** | **262.937.686,00** | **1,79** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **88.583.771,66** | **0,59** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **14.718.206.817,35** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 334.373.660,66 |
| | 30.09.2020 | USD | 208.557.447,43 |
| | 30.09.2019 | USD | 199.182.905,37 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.229,45 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.517,29 |
| | 30.09.2019 | USD | 6.638,39 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | - |
| | 30.09.2020 | CHF | 4.326,75 |
| | 30.09.2019 | CHF | 5.301,25 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.260,88 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.207,13 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 97,39 |
| | 30.09.2020 | GBP | 86,65 |
| | 30.09.2019 | GBP | 105,05 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 20.393,00 |
| | 30.09.2020 | PLN | 18.188,34 |
| | 30.09.2019 | PLN | 21.858,75 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 227,66 |
| | 30.09.2020 | USD | 203,25 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 223,71 |
| | 30.09.2020 | EUR | 201,67 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | - |
| | 30.09.2020 | GBP | 83,33 |
| | 30.09.2019 | GBP | 101,17 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 199,05 |
| | 30.09.2019 | USD | 243,22 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 256,82 |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.787,16 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.144,12 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.246,00 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 2 |
| | 30.09.2020 | | 1.684 |
| | 30.09.2019 | | 8.255 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 755 |
| | 30.09.2019 | 2.133 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 60 |
| | 30.09.2019 | 11.465 |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 94.912 |
| | 30.09.2020 | 40.218 |
| | 30.09.2019 | 7.848 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 887 |
| | 30.09.2020 | 1.845 |
| | 30.09.2019 | 2.139 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 14 |
| | 30.09.2020 | 23 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 3.202 |
| | 30.09.2020 | 2.095 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 73 |
| | 30.09.2019 | 73 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 6.633 |
| | 30.09.2019 | 8.228 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 29 |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 47.191 |
| | 30.09.2020 | 29.905 |
| | 30.09.2019 | 7.822 |
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,80% |
| Capitalisation I Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,55% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,57% |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,23% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (82,91%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **160.460.008,05** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 66.851,37 |
| Geldmarktinstrumente | | 160.393.156,68 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **6.695.746,37** |
| Total Return Swaps | | 2.792.482,87 |
| Futures | | 3.903.263,50 |
| **Bankguthaben** | | **133.642.439,20** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **56.492.227,14** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **75.164.268,01** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***432.454.688,77*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(1.437.723,10)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(90.171.057,15)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(6.472.247,86)** |
| Devisentermingeschäfte | | (6.472.247,86) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(98.081.028,11)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***334.373.660,66*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **763.082,98** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 629.807,24 |
| Bankzinsen | | 132.484,98 |
| Zinsen auf Swaps | | 790,76 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.056.055,88)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (105.162,07) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (626.417,60) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (65.224,71) |
| Abonnementsteuer | 9 | (33.469,63) |
| Bankzinsen | | (225.781,87) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(292.972,90)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 1.225.638,67 |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 476.939.610,80 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (440.811.749,84) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 6.394.153,71 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (6.789.979,74) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (103.990,16) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.423.244,58) |
| **Ergebnis** | | **35.137.465,96** |
| Zeichnungen | | 175.111.136,73 |
| Rücknahmen | | (84.432.389,46) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 208.557.447,43 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***334.373.660,66*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 10.300 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.500% 15/02/2045 | USD | 11.124,00 | 0,01 |
| 8.900 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 3.125% 15/11/2041 | USD | 10.600,73 | 0,01 |
| 7.300 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 5.250% 15/02/2029 | USD | 9.312,06 | 0,00 |
| 7.300 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 5.250% 15/11/2028 | USD | 9.271,00 | 0,00 |
| 6.700 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.125% 15/08/2029 | USD | 9.098,39 | 0,00 |
| 6.800 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.625% 15/02/2027 | USD | 8.779,44 | 0,00 |
| 6.800 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 6.750% 15/08/2026 | USD | 8.665,75 | 0,00 |
| | | | **66.851,37** | **0,02** |
| | | | **66.851,37** | **0,02** |
| **Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 10.000.000 | GOLDMAN SACHS INTERNATIONAL BANK ZCP 09/03/2022 (1) | USD | 9.987.579,70 | 2,99 |
| 15.000.000 | MITSUBISHI CORP ZCP 22/10/2021 | USD | 14.999.061,75 | 4,48 |
| 10.000.000 | QATAR NATIONAL BANK (Q.P.S.C.) ZCP 28/03/2022 (1) | USD | 9.983.830,40 | 2,99 |
| 10.000.000 | UBS AG ZCP 16/03/2022 (1) | USD | 9.992.454,00 | 2,98 |
| | | | **44.962.925,85** | **13,44** |
| **Luxemburg** | | | | |
| 10.000.000 | AGRICULTURAL BANK OF CHINA ZCP 21/01/2022 (1) | USD | 9.992.329,20 | 2,99 |
| 10.000.000 | CLEARSTREAM INTERNATIONAL ZCP 20/12/2021 | USD | 9.997.261,80 | 2,98 |
| 4.000.000 | DZ PRIVATBANK S.A. ZCP 08/02/2022 | USD | 3.997.799,52 | 1,20 |
| 5.000.000 | INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA ZCP 15/04/2022 (1) | USD | 4.991.443,25 | 1,49 |
| | | | **28.978.833,77** | **8,66** |
| **Deutschland** | | | | |
| 13.000.000 | HSH PORTFOLIOMANAGEMENT AOER ZCP 12/05/2022 | USD | 12.987.422,89 | 3,88 |
| 15.000.000 | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU ZCP 01/03/2022 | USD | 14.991.256,95 | 4,49 |
| | | | **27.978.679,84** | **8,37** |
| **Belgien** | | | | |
| 15.000.000 | ENI FINANCE ZCP 12/11/2021 | USD | 14.997.533,25 | 4,49 |
| | | | **14.997.533,25** | **4,49** |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 13.000.000 | AGENCE CENTRALE DES ORGANISMES DE SÉCURITÉ SOCIALE ZCP 02/03/2022 | USD | 12.991.258,93 | 3,89 |
| | | | **12.991.258,93** | **3,89** |
| **Niederlande** | | | | |
| 10.500.000 | ENEL FINANCE INTERNATIONAL ZCP 03/12/2021 | USD | 10.497.012,54 | 3,14 |
| | | | **10.497.012,54** | **3,14** |
| **Australien** | | | | |
| 10.000.000 | MIZUHO BANK LTD ZCP 25/10/2021 | USD | 9.999.279,70 | 2,99 |
| | | | **9.999.279,70** | **2,99** |
| **China** | | | | |
| 10.000.000 | CHINA CONSTRUCTION BANK/SEOUL ZCP 14/01/2022 (1) | USD | 9.987.632,80 | 2,99 |
| | | | **9.987.632,80** | **2,99** |
| | | | **160.393.156,68** | **47,97** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **160.460.008,05** | **47,99** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Stückzahl | Bezeichnung | Fälligkeitsdatum | Währung | Nennwert | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|
| **Total Return Swaps** | | | | | |
| 4.469.418 | TRS COMMODITY ENHANCED CURVE INDEX | 27/01/2022 | USD | 421.712.815,10 | 17.565.259,11 |
| 1.099.729 | TRS LEAN HOGS CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 57.970.000,00 | 3.446.439,85 |
| 306.947 | TRS WTI CRUDE OIL CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 30.442.000,00 | 2.023.611,63 |
| 421.986 | TRS NATURAL GAS CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 12.122.000,00 | 1.947.252,10 |
| 390.086 | TRS BRENT CRUDE CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 28.009.000,00 | 1.925.266,38 |
| 178.322 | TRS UNLEADED GASOLINE CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 29.314.000,00 | 1.633.361,11 |
| 274.412 | TRS ZINC CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 41.194.000,00 | 1.607.232,72 |
| 351.158 | TRS SUGAR CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 40.729.000,00 | 1.593.028,64 |
| 96.784 | TRS HEATING OIL CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 12.199.000,00 | 853.986,13 |
| 78.142 | TRS COTTON CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 8.163.000,00 | 678.419,97 |
| 132.617 | TRS SOYBEANS CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 23.331.000,00 | 659.544,31 |
| 158.351 | TRS SOYBEAN MEAL CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 13.375.000,00 | 280.928,88 |
| 92.416 | TRS CORN CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 8.097.000,00 | 276.896,75 |
| 41.256 | TRS COFFEE CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 3.511.000,00 | 176.070,30 |
| 14.918 | TRS GAS OIL CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 1.649.000,00 | 130.322,33 |
| 9.774.000 | TRS LIVE CATTLE CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 96.387,69 | (164.264,83) |
| 19.006.000 | TRS NICKEL CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 100.816,55 | (491.396,52) |
| 15.491.000 | TRS SOYBEAN OIL CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 126.913,52 | (532.961,43) |
| 8.027.000 | TRS ALUMINUM SUBINDEX CAPPED | 30/11/2021 | USD | 78.647,41 | (569.673,10) |
| 19.636.000 | TRS COPPER CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 103.009,57 | (596.583,49) |
| 26.896.000 | TRS SILVER CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 156.660,18 | (626.467,75) |
| 40.567.000 | TRS WHEAT CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 544.451,86 | (1.313.924,87) |
| 38.560.000 | TRS KANSAS WHEAT CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 665.579,23 | (1.571.365,90) |
| 131.681.000 | TRS GOLD CAPPED INDEX | 30/11/2021 | USD | 774.982,96 | (5.272.051,22) |
| 419.698.439 | TRS COMMODITY INDEX | 27/01/2022 | USD | 4.372.500,94 | (20.866.448,23) |
| | | | | | **2.792.482,87** |

(1) Kurzfristiges Einlagenzertifikat.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Multi Asset Factor Opportunities

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

### Devisentermingeschäfte

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 153.984.266,04 | USD | 142.713.000,00 | CHF | 28/10/2021 | 153.984.266,04 | 905.868,51 |
| 79.935.550,52 | USD | 68.408.000,00 | EUR | 28/10/2021 | 79.935.550,52 | 616.961,30 |
| 55.623.584,88 | USD | 40.861.000,00 | GBP | 28/10/2021 | 55.623.584,88 | 526.857,84 |
| 9.150.169,46 | USD | 10.529.100.000,00 | KRW | 28/10/2021 | 9.150.169,46 | 257.356,68 |
| 43.144.801,14 | USD | 59.432.889,76 | AUD | 28/10/2021 | 43.144.801,14 | 208.941,90 |
| 28.113.000,00 | NZD | 19.310.398,01 | USD | 28/10/2021 | 19.310.398,01 | 80.779,84 |
| 8.933.489,45 | USD | 10.529.100.000,00 | KRW | 30/12/2021 | 8.933.489,45 | 47.486,86 |
| 938.688,57 | USD | 1.348.806,75 | NZD | 28/10/2021 | 938.688,57 | 8.337,79 |
| 54.289,06 | USD | 39.376,51 | GBP | 19/10/2021 | 54.289,06 | 1.194,73 |
| 90.684,49 | USD | 66.999,99 | GBP | 01/10/2021 | 90.684,49 | 345,03 |
| 96.512.000,00 | SEK | 11.053.567,81 | USD | 28/10/2021 | 11.053.567,81 | (19.870,97) |
| 10.529.100.000,00 | KRW | 8.941.227,42 | USD | 28/10/2021 | 8.941.227,42 | (48.414,64) |
| 10.310.520,84 | USD | 90.631.000,00 | SEK | 28/10/2021 | 10.310.520,84 | (50.832,96) |
| 39.517.000,00 | AUD | 28.639.333,24 | USD | 28/10/2021 | 28.639.333,24 | (91.228,70) |
| 108.758.000,00 | CAD | 85.995.696,02 | USD | 28/10/2021 | 85.995.696,02 | (149.659,72) |
| 93.588.458,37 | USD | 10.459.931.000,00 | JPY | 28/10/2021 | 93.588.458,37 | (175.325,04) |
| 12.044.182.000,00 | JPY | 108.142.716,42 | USD | 28/10/2021 | 108.142.716,42 | (177.561,40) |
| 18.219.033,56 | PLN | 4.788.123,05 | USD | 19/10/2021 | 4.788.123,05 | (200.493,14) |
| 9.345.660,95 | GBP | 12.871.455,36 | USD | 19/10/2021 | 12.871.455,36 | (269.992,17) |
| 484.167.000,00 | NOK | 56.022.056,66 | USD | 28/10/2021 | 56.022.056,66 | (567.274,11) |
| 273.828.783,42 | EUR | 324.823.407,69 | USD | 19/10/2021 | 324.823.407,69 | (7.375.725,49) |
| | | | | | **1.116.342.484,50** | **(6.472.247,86)** |

### Futures auf Aktienindizes

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| 118 | CBOE VIX FUTURE 17/11/2021 | USD | 2.794.936,20 | 36.703,66 |
| (145) | EURO STOXX 50 17/12/2021 | EUR | 6.802.572,81 | 75.932,69 |
| 387 | FTSE 100 INDEX FUTURE 17/12/2021 | GBP | 36.910.331,65 | 437.185,17 |
| (163) | HANG SENG INDEX FUTURE 28/10/2021 | HKD | 25.674.962,91 | (403.178,05) |
| (253) | KOSPI2 INDEX FUTURE 09/12/2021 | KRW | 21.448.374,16 | 629.328,55 |
| 300 | NIKKEI 225 (SGX) 09/12/2021 | JPY | 39.887.967,73 | (204.060,05) |
| 1.187 | OMXS30 INDEX FUTURE 15/10/2021 | SEK | 30.572.011,93 | (775.826,85) |
| 267 | SPI 200 FUTURES 16/12/2021 | AUD | 35.164.556,30 | (530.988,17) |
| 282 | S&P/TSX 60 IX FUTURE 16/12/2021 | CAD | 53.250.219,05 | (1.148.004,31) |
| 212 | S&P500 EMINI FUTURE 17/12/2021 | USD | 45.556.150,00 | (1.632.172,50) |
| (590) | SWISS MARKET INDEX FUTURE 17/12/2021 | CHF | 73.372.889,53 | 2.757.656,64 |
| | | | **371.434.972,27** | **(757.423,22)** |

### Zins-Futures

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| (257) | AUSTRALIA 10Y BOND FUTURE 15/12/2021 | AUD | 26.263.526,14 | 79.384,74 |
| (261) | CANADA 10YR BOND FUTURE 20/12/2021 | CAD | 29.492.165,61 | 201.213,06 |
| (52) | EURO-BTP FUTURE 08/12/2021 | EUR | 9.157.327,38 | 34.490,78 |
| (1.066) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 209.802.536,16 | 2.506.600,20 |
| (309) | EURO-OAT FUTURE 08/12/2021 | EUR | 59.429.274,53 | 562.694,98 |
| 1.420 | KOREA 10YR BOND FUTURE 21/12/2021 | KRW | 148.968.074,32 | (2.656.397,02) |
| (1.486) | LONG GILT FUTURE 29/12/2021 | GBP | 250.756.551,09 | 6.173.811,28 |
| 1.315 | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 173.066.328,13 | (2.241.111,30) |
| | | | **906.935.783,36** | **4.660.686,72** |

| | |
|---|---|
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **223.498,51** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **160.460.008,05** | **47,99** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **223.498,51** | **0,07** |
| **Bankguthaben** | **133.642.439,20** | **39,97** |
| **Bankverbindlichkeiten** | **(1.437.723,10)** | **(0,43)** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **41.485.438,00** | **12,40** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **334.373.660,66** | **100,00** |

(1) Kurzfristiges Einlagenzertifikat.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Multi Asset High Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 5.652.977,10 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.067.310,90 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.609.782,54 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.447,87 |
| | 30.09.2020 | EUR | 4.903,64 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.458,78 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 261,54 |
| | 30.09.2020 | EUR | 236,99 |
| | 30.09.2019 | EUR | 265,90 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.637,50 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.043,76 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.582,64 |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 207,20 |
| | 30.09.2020 | EUR | 197,57 |
| | 30.09.2019 | EUR | 233,05 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 7 |
| | 30.09.2020 | | 7 |
| | 30.09.2019 | | 7 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 86 |
| | 30.09.2020 | | 107 |
| | 30.09.2019 | | 107 |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 991 |
| | 30.09.2020 | | 991 |
| | 30.09.2019 | | 991 |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | | 13 |
| | 30.09.2020 | | 33 |
| | 30.09.2019 | | 33 |
| **Dividende** | | | |
| Distribution X (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 8,60 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 1,20% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 1,91% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,60% |
| Distribution X (EUR) | 30.09.2021 | | 2,70% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 167,34% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Multi Asset High Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **5.567.964,99** |
| Organismen für gemeinsame Anlagen | | 5.202.164,17 |
| Börsengehandelte Wertpapiere | | 86.279,07 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 279.521,75 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **7.078,98** |
| Futures | | 7.078,98 |
| **Bankguthaben** | | **88.372,49** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **76.927,67** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **12.306,27** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***5.752.650,40*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(41.349,29)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(18.059,52)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(40.264,49)** |
| Credit Default Swaps | | (16.245,33) |
| Devisentermingeschäfte | | (24.019,16) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(99.673,30)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***5.652.977,10*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **22.816,91** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 5.201,17 |
| Bankzinsen | | 17,14 |
| Sonstige Erträge | 10 | 17.598,60 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(16.985,17)** |
| Feste Servicegebühr | 6 | (8.185,47) |
| Bankzinsen | | (2.721,45) |
| Zinsen auf Swaps | | (6.078,25) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **5.831,74** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 446.065,48 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (49.755,42) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 313.647,85 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (430.669,51) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 45.210,18 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (55.200,61) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 312.907,15 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 7.154,20 |
| **Ergebnis** | | **595.191,06** |
| Zeichnungen | | 1.999,83 |
| Rücknahmen | | (11.243,36) |
| Ausschüttung | | (281,33) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 5.067.310,90 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***5.652.977,10*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Multi Asset High Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Frankreich** | | | | |
| 50.131 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.100% 01/03/2029 | EUR | 57.846,83 | 1,02 |
| 49.456 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 3.150% 25/07/2032 | EUR | 77.378,52 | 1,37 |
| | | | **135.225,35** | **2,39** |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 32.511 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/01/2031 | USD | 30.801,79 | 0,54 |
| 34.180 | UNITED STATES TREASURY INFLATION INDEXED BONDS 0.125% 15/07/2030 | USD | 32.535,92 | 0,58 |
| 15.800 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.250% 15/05/2041 | USD | 14.180,48 | 0,25 |
| | | | **77.518,19** | **1,37** |
| **Deutschland** | | | | |
| 54.036 | DEUTSCHE BUNDESREPUBLIK INFLATION LINKED BOND 0.500% 15/04/2030 | EUR | 66.778,21 | 1,18 |
| | | | **66.778,21** | **1,18** |
| | | | **279.521,75** | **4,94** |
| **Börsengehandelte Wertpapiere** | | | | |
| **Jersey** | | | | |
| 1.304 | WISDOMTREE CARBON | USD | 27.836,37 | 0,50 |
| 397 | XTRACKERS PHYSICAL GOLD ETC | USD | 58.442,70 | 1,03 |
| | | | **86.279,07** | **1,53** |
| | | | **86.279,07** | **1,53** |
| **Organismen für gemeinsame Anlagen** | | | | |
| **Offene Fonds** | | | | |
| **Luxemburg** | | | | |
| 2.209 | LUMYNA - MARSHALL WACE TOPS MARKET NEUTRAL UCITS FUND | USD | 341.351,92 | 6,04 |
| 3.262 | LUMYNA - PSAM GLOBAL EVENT UCITS FUND | USD | 342.229,24 | 6,06 |
| 57 | NN (L) EMERGING MARKETS CORPORATE DEBT - Z CAP USD | USD | 360.253,08 | 6,37 |
| 29 | NN (L) EMERGING MARKETS DEBT (HARD CURRENCY) - I CAP USD | USD | 224.958,88 | 3,98 |
| 47 | NN (L) EMERGING MARKETS ENHANCED INDEX SUSTAINABLE EQUITY - I CAP EUR | EUR | 269.136,57 | 4,76 |
| 54 | NN (L) EUROPEAN ABS - I CAP EUR | EUR | 284.769,54 | 5,04 |
| 1.198 | NN (L) EUROPEAN HIGH DIVIDEND - I CAP EUR | EUR | 669.849,72 | 11,85 |
| 53 | NN (L) GLOBAL ENHANCED INDEX SUSTAINABLE EQUITY - I CAP USD | USD | 327.031,88 | 5,79 |
| 1.636 | NN (L) GLOBAL HIGH YIELD - I CAP EUR (HEDGED III) | EUR | 1.030.500,04 | 18,23 |
| 1.542 | NN (L) GLOBAL SUSTAINABLE EQUITY - I CAP EUR | EUR | 1.041.975,66 | 18,43 |
| 21 | NN (L) US HIGH YIELD - Z CAP USD | USD | 117.589,13 | 2,08 |
| | | | **5.009.645,66** | **88,63** |
| **Irland** | | | | |
| 24.111 | ISHARES CHINA CNY BOND UCITS ETF | USD | 117.110,87 | 2,07 |
| | | | **117.110,87** | **2,07** |
| **Jersey** | | | | |
| 8.320 | WISDOMTREE ALUMINIUM | USD | 28.521,82 | 0,50 |
| 2.925 | WISDOMTREE WTI CRUDE OIL | USD | 17.546,97 | 0,31 |
| 3.709 | WISDOMTREE ZINC | USD | 29.338,85 | 0,52 |
| | | | **75.407,64** | **1,33** |
| | | | **5.202.164,17** | **92,03** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **5.567.964,99** | **98,50** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeich-nung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeits-datum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swaps** | | | | | | |
| CDX NORTH AMERICA HIGH YIELD SERIES 37 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | USD | 70.000,00 | (5.621,59) |
| CDX ITRAXX EUROPE CROSSOVER SERIES 36 VERSION 1 | Kauf | 5,000 | 20/12/2026 | EUR | 90.000,00 | (10.623,74) |
| | | | | | | **(16.245,33)** |

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 440.000,00 | USD | 373.118,65 | EUR | 26/11/2021 | 373.118,65 | 6.138,40 |
| 55.930,34 | EUR | 48.000,00 | GBP | 26/11/2021 | 55.930,34 | 142,72 |
| 37.144,82 | EUR | 4.800.000,00 | JPY | 26/11/2021 | 37.144,82 | 49,66 |
| 2.219.333,94 | EUR | 2.610.000,00 | USD | 26/11/2021 | 2.219.333,94 | (30.349,94) |
| | | | | | **2.685.527,75** | **(24.019,16)** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Futures auf Aktienindizes** | | | | |
| (3) | DOW JONES INDUSTRIAL AVERAGE MINI E-CBOT 17/12/2021 | USD | 436.455,41 | 13.357,03 |
| (2) | EURO STOXX 50 17/12/2021 | EUR | 80.960,00 | 2.117,89 |
| (1) | MSCI EMRGING MARKETS 17/12/2021 | USD | 53.738,30 | 1.708,15 |
| | | | **571.153,71** | **17.183,07** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Multi Asset High Income

*(ausgedrückt in EUR)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl | Bezeichnung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| 7 | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 794.914,04 | (10.535,51) |
| (4) | US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 759.496,74 | 431,42 |
| | | | **1.554.410,78** | **(10.104,09)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(33.185,51)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **5.567.964,99** | **98,50** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(33.185,51)** | **(0,59)** |
| **Bankguthaben** | **88.372,49** | **1,56** |
| **Bankverbindlichkeiten** | **(41.349,29)** | **(0,73)** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **71.174,42** | **1,26** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **5.652.977,10** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 814.352.387,74 |
| | 30.09.2020 | USD | 224.022.517,51 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 7.313,79 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.742,63 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 363,16 |
| | 30.09.2020 | USD | 286,12 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation Q (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 692.435,53 |
| | 30.09.2020 | EUR | 537.233,63 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 364,89 |
| | 30.09.2020 | USD | 286,83 |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 255,21 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 722.842,36 |
| | 30.09.2020 | EUR | 560.663,26 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.812,21 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.343,14 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 14.196 |
| | 30.09.2020 | | 12 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 9 |
| | 30.09.2020 | | 29 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation Q (EUR) | 30.09.2021 | | 100 |
| | 30.09.2020 | | 91 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | | 9 |
| | 30.09.2020 | | 29 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 8 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 741 |
| | 30.09.2020 | | 206 |
| | 30.09.2019 | | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | | 1.247 |
| | 30.09.2020 | | 5.005 |
| | 30.09.2019 | | - |
| **Dividende** | | | |
| Distribution Z (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 62,65 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 0,19% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 0,53% |
| Capitalisation Q (EUR) | 30.09.2021 | | 0,14% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | | 0,28% |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | | 1,03% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,11% |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,11% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 9,83% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **812.807.550,78** |
| Aktien | | 812.807.550,78 |
| **Bankguthaben** | | **1.908.459,22** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **843.356,32** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***815.559.366,32*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(1.206.921,40)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(57,18)** |
| Devisentermingeschäfte | | (57,18) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(1.206.978,58)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***814.352.387,74*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **6.503.615,30** |
| Dividenden | | 6.503.527,30 |
| Bankzinsen | | 88,00 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(712.558,45)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (46.800,27) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (601.116,98) |
| Abonnementsteuer | 9 | (64.641,20) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **5.791.056,85** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 33.236.070,86 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (2.132.747,61) |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (59,34) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 2.402.275,27 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (2.549.611,40) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 81.751.508,13 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (57,18) |
| **Ergebnis** | | **118.498.435,58** |
| Zeichnungen | | 657.902.845,18 |
| Rücknahmen | | (185.691.215,09) |
| Ausschüttung | | (380.195,44) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 224.022.517,51 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***814.352.387,74*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

#### Vereinigte Staaten

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 40.539 | ABBOTT LABORATORIES | USD | 4.788.872,07 | 0,59 |
| 41.317 | ABBVIE INC | USD | 4.456.864,79 | 0,55 |
| 23.084 | ACTIVISION BLIZZARD INC | USD | 1.786.470,76 | 0,22 |
| 11.102 | ADOBE INC | USD | 6.391.643,44 | 0,78 |
| 31.179 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | USD | 3.208.319,10 | 0,39 |
| 27.612 | AFLAC INC | USD | 1.439.413,56 | 0,18 |
| 10.236 | AGILENT TECHNOLOGIES INC | USD | 1.612.477,08 | 0,20 |
| 24.714 | AGNC INVESTMENT CORP | USD | 389.739,78 | 0,05 |
| 5.641 | AIR PRODUCTS AND CHEMICALS INC | USD | 1.444.716,51 | 0,18 |
| 3.643 | AKAMAI TECHNOLOGIES INC | USD | 381.021,37 | 0,05 |
| 6.263 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | USD | 1.196.671,41 | 0,15 |
| 2.692 | ALIGN TECHNOLOGY INC | USD | 1.791.337,56 | 0,22 |
| 7.866 | ALLSTATE CORP/THE | USD | 1.001.420,46 | 0,12 |
| 14.930 | ALLY FINANCIAL INC | USD | 762.176,50 | 0,09 |
| 5.159 | ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | USD | 974.070,79 | 0,12 |
| 5.727 | ALPHABET INC - A | USD | 15.311.249,04 | 1,88 |
| 6.588 | ALPHABET INC - C | USD | 17.559.062,28 | 2,16 |
| 4.150 | ALTICE USA INC - A | USD | 85.988,00 | 0,01 |
| 9.281 | AMAZON.COM INC | USD | 30.488.456,24 | 3,74 |
| 22.222 | AMERICAN EXPRESS CO | USD | 3.722.851,66 | 0,46 |
| 25.890 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC | USD | 1.421.102,10 | 0,17 |
| 11.866 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 3.149.355,06 | 0,39 |
| 4.198 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 1.108.775,76 | 0,14 |
| 675 | AMERISOURCEBERGEN CORP - A | USD | 80.628,75 | 0,01 |
| 14.040 | AMGEN INC | USD | 2.985.606,00 | 0,37 |
| 48.492 | ANNALY CAPITAL MANAGEMENT INC | USD | 408.302,64 | 0,05 |
| 2.124 | ANSYS INC | USD | 723.115,80 | 0,09 |
| 5.832 | ANTHEM INC | USD | 2.174.169,60 | 0,27 |
| 334.394 | APPLE INC | USD | 47.316.751,00 | 5,80 |
| 29.047 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 3.739.220,31 | 0,46 |
| 1.882 | ARISTA NETWORKS INC | USD | 646.730,48 | 0,08 |
| 6.805 | ARTHUR J GALLAGHER & CO | USD | 1.011.563,25 | 0,12 |
| 1.075 | ASSURANT INC | USD | 169.581,25 | 0,02 |
| 174.057 | AT&T INC | USD | 4.701.279,57 | 0,57 |
| 6.103 | AUTODESK INC | USD | 1.740.392,51 | 0,21 |
| 7.186 | AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | USD | 1.436.625,12 | 0,18 |
| 5.324 | AVALARA INC | USD | 930.475,48 | 0,11 |
| 4.423 | AVALONBAY COMMUNITIES INC | USD | 980.313,72 | 0,12 |
| 79.849 | BAKER HUGHES CO - A | USD | 1.974.665,77 | 0,24 |
| 208.203 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 8.838.217,35 | 1,08 |
| 29.316 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE | USD | 1.519.741,44 | 0,19 |
| 6.957 | BAXTER INTERNATIONAL INC | USD | 559.551,51 | 0,07 |
| 6.397 | BECTON DICKINSON AND CO | USD | 1.572.510,54 | 0,19 |
| 6.950 | BEST BUY CO INC | USD | 734.684,50 | 0,09 |
| 4.049 | BIOGEN INC | USD | 1.145.826,51 | 0,14 |
| 7.223 | BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | USD | 558.265,67 | 0,07 |
| 574 | BIO-RAD LABORATORIES INC - A | USD | 428.175,30 | 0,05 |
| 719 | BIO-TECHNE CORP | USD | 348.405,83 | 0,04 |
| 1.376 | BOOKING HOLDINGS INC | USD | 3.266.445,12 | 0,40 |
| 5.711 | BOSTON PROPERTIES INC | USD | 618.786,85 | 0,08 |
| 5.173 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | USD | 224.456,47 | 0,03 |
| 55.804 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 3.301.922,68 | 0,41 |
| 8.947 | BROADCOM INC | USD | 4.338.668,71 | 0,53 |
| 723 | BROWN & BROWN INC | USD | 40.090,35 | 0,00 |
| 2.196 | BROWN-FORMAN CORP - B | USD | 147.153,96 | 0,02 |
| 2.383 | BURLINGTON STORES INC | USD | 675.747,31 | 0,08 |
| 7.479 | CADENCE DESIGN SYSTEMS INC | USD | 1.132.619,76 | 0,14 |
| 9.028 | CAMPBELL SOUP CO | USD | 377.460,68 | 0,05 |
| 5.016 | CARMAX INC | USD | 641.847,36 | 0,08 |
| 25.819 | CARRIER GLOBAL CORP | USD | 1.336.391,44 | 0,16 |
| 2.946 | CARVANA CO - A | USD | 888.336,84 | 0,11 |
| 1.526 | CATALENT INC | USD | 203.064,82 | 0,02 |
| 4.577 | CBOE GLOBAL MARKETS INC | USD | 566.907,22 | 0,07 |
| 9.885 | CBRE GROUP INC - A | USD | 962.403,60 | 0,12 |
| 9.220 | CENTENE CORP | USD | 574.498,20 | 0,07 |
| 4.669 | CH ROBINSON WORLDWIDE INC | USD | 406.203,00 | 0,05 |
| 322 | CHARLES RIVER LABORATORIES INTERNATIONAL INC | USD | 132.879,74 | 0,02 |
| 35.508 | CHARLES SCHWAB CORP/THE | USD | 2.586.402,72 | 0,32 |
| 3.432 | CHARTER COMMUNICATIONS INC - A | USD | 2.496.985,92 | 0,31 |
| 86.202 | CHEVRON CORP | USD | 8.745.192,90 | 1,07 |
| 11.922 | CHURCH & DWIGHT CO INC | USD | 984.399,54 | 0,12 |
| 9.643 | CIGNA CORP | USD | 1.930.142,88 | 0,24 |
| 3.541 | CINCINNATI FINANCIAL CORP | USD | 404.453,02 | 0,05 |
| 83.396 | CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE | USD | 4.539.244,28 | 0,56 |
| 13.916 | CITIZENS FINANCIAL GROUP INC | USD | 653.773,68 | 0,08 |
| 428 | CITRIX SYSTEMS INC | USD | 45.954,36 | 0,01 |
| 4.308 | CLOROX CO/THE | USD | 713.447,88 | 0,09 |
| 10.394 | CME GROUP INC - A | USD | 2.009.991,72 | 0,25 |
| 8.222 | COGNIZANT TECHNOLOGY SOLUTIONS CORP - A | USD | 610.154,62 | 0,07 |
| 29.074 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 2.197.412,92 | 0,27 |
| 101.638 | COMCAST CORP - A | USD | 5.684.613,34 | 0,70 |
| 21.147 | CONAGRA BRANDS INC | USD | 716.248,89 | 0,09 |
| 8.386 | CONSTELLATION BRANDS INC - A | USD | 1.766.846,34 | 0,22 |
| 1.205 | COOPER COS INC/THE | USD | 498.038,55 | 0,06 |
| 14.309 | CORTEVA INC | USD | 602.122,72 | 0,07 |
| 16.072 | COSTAR GROUP INC | USD | 1.383.156,32 | 0,17 |
| 15.585 | COSTCO WHOLESALE CORP | USD | 7.003.119,75 | 0,86 |
| 1.930 | COUPA SOFTWARE INC | USD | 423.017,40 | 0,05 |
| 11.860 | CROWN CASTLE INTERNATIONAL CORP | USD | 2.055.575,20 | 0,25 |
| 70.140 | CSX CORP | USD | 2.085.963,60 | 0,26 |
| 6.903 | CUMMINS INC | USD | 1.550.137,68 | 0,19 |
| 28.809 | CVS HEALTH CORP | USD | 2.444.731,74 | 0,30 |
| 17.043 | DANAHER CORP | USD | 5.188.570,92 | 0,64 |
| 8.991 | DEERE & CO | USD | 3.012.614,37 | 0,37 |
| 4.049 | DELL TECHNOLOGIES INC - C | USD | 421.257,96 | 0,05 |
| 18.664 | DELTA AIR LINES INC | USD | 795.273,04 | 0,10 |
| 8.759 | DENTSPLY SIRONA INC | USD | 508.459,95 | 0,06 |
| 3.474 | DEXCOM INC | USD | 1.899.791,64 | 0,23 |
| 11.941 | DISCOVER FINANCIAL SERVICES | USD | 1.466.951,85 | 0,18 |
| 10.285 | DISH NETWORK CORP - A | USD | 446.986,10 | 0,05 |
| 6.765 | DOCUSIGN INC - A | USD | 1.741.513,95 | 0,21 |
| 1.199 | DOMINO'S PIZZA INC | USD | 571.875,04 | 0,07 |
| 8.882 | DOVER CORP | USD | 1.381.151,00 | 0,17 |
| 24.954 | DOW INC | USD | 1.436.352,24 | 0,18 |
| 7.509 | DR HORTON INC | USD | 630.530,73 | 0,08 |
| 21.023 | EBAY INC | USD | 1.464.672,41 | 0,18 |
| 7.422 | ECOLAB INC | USD | 1.548.377,64 | 0,19 |
| 18.893 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 2.138.876,53 | 0,26 |
| 11.739 | ELANCO ANIMAL HEALTH INC | USD | 374.356,71 | 0,05 |
| 9.457 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 1.345.258,25 | 0,17 |
| 19.208 | ELI LILLY & CO | USD | 4.438.008,40 | 0,54 |
| 26.372 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 2.484.242,40 | 0,31 |
| 4.663 | ENPHASE ENERGY INC | USD | 699.310,11 | 0,09 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.697 | EPAM SYSTEMS INC | USD | 968.104,56 | 0,12 |
| 23.875 | EQUITABLE HOLDINGS INC | USD | 707.655,00 | 0,09 |
| 13.709 | EQUITY RESIDENTIAL | USD | 1.109.332,28 | 0,14 |
| 51.726 | ESSENTIAL UTILITIES INC | USD | 2.383.534,08 | 0,29 |
| 1.683 | ESSEX PROPERTY TRUST INC | USD | 538.122,42 | 0,07 |
| 5.372 | ETSY INC | USD | 1.117.161,12 | 0,14 |
| 67.439 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 5.513.812,64 | 0,68 |
| 6.477 | EXACT SCIENCES CORP | USD | 618.229,65 | 0,08 |
| 8.413 | EXPEDITORS INTERNATIONAL OF WASHINGTON INC | USD | 1.002.240,69 | 0,12 |
| 367 | FAIR ISAAC CORP | USD | 146.040,31 | 0,02 |
| 20.178 | FASTENAL CO | USD | 1.041.386,58 | 0,13 |
| 7.604 | FEDEX CORP | USD | 1.667.481,16 | 0,20 |
| 9.469 | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC | USD | 429.324,46 | 0,05 |
| 14.421 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC | USD | 1.754.747,28 | 0,22 |
| 30.536 | FIFTH THIRD BANCORP | USD | 1.295.947,84 | 0,16 |
| 4.934 | FIRST REPUBLIC BANK/CA | USD | 951.669,92 | 0,12 |
| 12.662 | FISERV INC | USD | 1.373.827,00 | 0,17 |
| 810 | FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | USD | 211.628,70 | 0,03 |
| 7.711 | FMC CORP | USD | 706.019,16 | 0,09 |
| 210.502 | FORD MOTOR CO | USD | 2.980.708,32 | 0,36 |
| 5.316 | FORTINET INC | USD | 1.552.484,64 | 0,19 |
| 13.130 | FORTIVE CORP | USD | 926.584,10 | 0,11 |
| 10.244 | FORTUNE BRANDS HOME & SECURITY INC | USD | 916.018,48 | 0,11 |
| 16.145 | FOX CORP - A | USD | 647.575,95 | 0,08 |
| 8.372 | FRANKLIN RESOURCES INC | USD | 248.815,84 | 0,03 |
| 840 | GARTNER INC | USD | 255.259,20 | 0,03 |
| 2.837 | GENERAC HOLDINGS INC | USD | 1.159.396,79 | 0,14 |
| 24.550 | GENERAL MILLS INC | USD | 1.468.581,00 | 0,18 |
| 29.698 | GILEAD SCIENCES INC | USD | 2.074.405,30 | 0,25 |
| 7.345 | GLOBAL PAYMENTS INC | USD | 1.157.425,10 | 0,14 |
| 8.468 | GODADDY INC - A | USD | 590.219,60 | 0,07 |
| 6.658 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE | USD | 2.516.923,74 | 0,31 |
| 86.606 | HALLIBURTON CO | USD | 1.872.421,72 | 0,23 |
| 9.841 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 691.330,25 | 0,08 |
| 5.057 | HASBRO INC | USD | 451.185,54 | 0,06 |
| 6.561 | HCA HEALTHCARE INC | USD | 1.592.485,92 | 0,20 |
| 17.431 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | USD | 583.589,88 | 0,07 |
| 2.218 | HENRY SCHEIN INC | USD | 168.922,88 | 0,02 |
| 11.097 | HERSHEY CO/THE | USD | 1.878.167,25 | 0,23 |
| 9.522 | HILTON WORLDWIDE HOLDINGS INC | USD | 1.257.951,42 | 0,15 |
| 6.673 | HOLOGIC INC | USD | 492.534,13 | 0,06 |
| 23.261 | HOME DEPOT INC/THE | USD | 7.635.655,86 | 0,94 |
| 35.199 | HOST HOTELS & RESORTS INC | USD | 574.799,67 | 0,07 |
| 18.756 | HP INC | USD | 513.164,16 | 0,06 |
| 1.508 | HUBSPOT INC | USD | 1.019.543,72 | 0,13 |
| 2.583 | HUMANA INC | USD | 1.005.174,45 | 0,12 |
| 20.484 | HUNTINGTON BANCSHARES INC/OH | USD | 316.682,64 | 0,04 |
| 4.230 | IDEX CORP | USD | 875.398,50 | 0,11 |
| 3.051 | IDEXX LABORATORIES INC | USD | 1.897.416,90 | 0,23 |
| 12.218 | ILLINOIS TOOL WORKS INC | USD | 2.524.605,34 | 0,31 |
| 3.930 | ILLUMINA INC | USD | 1.594.047,30 | 0,20 |
| 6.851 | INCYTE CORP | USD | 471.211,78 | 0,06 |
| 18.477 | INGERSOLL-RAND PLC | USD | 931.425,57 | 0,11 |
| 3.040 | INSULET CORP | USD | 864.059,20 | 0,11 |
| 87.519 | INTEL CORP | USD | 4.663.012,32 | 0,57 |
| 14.051 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | USD | 1.613.335,82 | 0,20 |
| 12.209 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP | USD | 1.696.196,37 | 0,21 |
| 6.561 | INTERNATIONAL FLAVORS & FRAGRANCES INC | USD | 877.336,92 | 0,11 |
| 16.947 | INTERNATIONAL PAPER CO | USD | 947.676,24 | 0,12 |
| 25.917 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC/THE | USD | 950.376,39 | 0,12 |
| 6.926 | INTUIT INC | USD | 3.736.646,26 | 0,46 |
| 3.443 | INTUITIVE SURGICAL INC | USD | 3.422.858,45 | 0,42 |
| 221 | IPG PHOTONICS CORP | USD | 35.006,40 | 0,00 |
| 5.290 | IQVIA HOLDINGS INC | USD | 1.267.166,60 | 0,16 |
| 8.260 | IRON MOUNTAIN INC | USD | 358.897,00 | 0,04 |
| 5.836 | J M SMUCKER CO/THE | USD | 700.495,08 | 0,09 |
| 77.453 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 12.678.281,57 | 1,56 |
| 4.459 | KANSAS CITY SOUTHERN | USD | 1.206.783,76 | 0,15 |
| 1.126 | KELLOGG CO | USD | 71.973,92 | 0,01 |
| 17.834 | KEYCORP | USD | 385.571,08 | 0,05 |
| 219 | KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | USD | 35.979,51 | 0,00 |
| 131.117 | KINDER MORGAN INC/DE | USD | 2.193.587,41 | 0,26 |
| 4.801 | KLA CORP | USD | 1.605.982,51 | 0,20 |
| 29.532 | KROGER CO/THE | USD | 1.193.978,76 | 0,15 |
| 2.146 | LABORATORY CORP OF AMERICA HOLDINGS | USD | 603.970,24 | 0,07 |
| 4.024 | LAM RESEARCH CORP | USD | 2.290.259,60 | 0,28 |
| 10.441 | LEAR CORP | USD | 1.633.807,68 | 0,20 |
| 12.066 | LENNAR CORP - A | USD | 1.130.342,88 | 0,14 |
| 5.850 | LIBERTY BROADBAND CORP - C | USD | 1.010.295,00 | 0,12 |
| 1.236 | LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM - C | USD | 58.672,92 | 0,01 |
| 10.152 | LINCOLN NATIONAL CORP | USD | 697.950,00 | 0,09 |
| 7.592 | LIVE NATION ENTERTAINMENT INC | USD | 691.858,96 | 0,08 |
| 15.005 | LKQ CORP | USD | 755.051,60 | 0,09 |
| 17.922 | LOWE'S COS INC | USD | 3.635.656,92 | 0,45 |
| 4.322 | LULULEMON ATHLETICA INC | USD | 1.749.113,40 | 0,21 |
| 13.187 | LYFT INC - A | USD | 706.691,33 | 0,09 |
| 510 | MARKEL CORP | USD | 609.516,30 | 0,07 |
| 1.166 | MARKETAXESS HOLDINGS INC | USD | 490.524,54 | 0,06 |
| 10.583 | MARRIOTT INTERNATIONAL INC/MD - A | USD | 1.567.236,47 | 0,19 |
| 15.804 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 2.393.199,72 | 0,29 |
| 7.050 | MASCO CORP | USD | 391.627,50 | 0,05 |
| 14.669 | MASTERCARD INC - A | USD | 5.100.117,92 | 0,63 |
| 11.878 | MATCH GROUP INC | USD | 1.864.727,22 | 0,23 |
| 10.906 | MCCORMICK & CO INC/MD - NON VOTING | USD | 883.713,18 | 0,11 |
| 18.739 | MCDONALD'S CORP | USD | 4.518.160,29 | 0,55 |
| 54.486 | MERCK & CO INC | USD | 4.092.443,46 | 0,50 |
| 25.843 | METLIFE INC | USD | 1.595.288,39 | 0,20 |
| 438 | METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | USD | 603.283,68 | 0,07 |
| 25.143 | MICRON TECHNOLOGY INC | USD | 1.784.650,14 | 0,22 |
| 143.507 | MICROSOFT CORP | USD | 40.457.493,44 | 4,96 |
| 72.692 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A | USD | 4.229.220,56 | 0,52 |
| 3.599 | MONGODB INC - A | USD | 1.696.964,49 | 0,21 |
| 12.171 | MONSTER BEVERAGE CORP | USD | 1.081.149,93 | 0,13 |
| 5.370 | MOODY'S CORP | USD | 1.906.940,70 | 0,23 |
| 48.310 | MORGAN STANLEY | USD | 4.701.046,10 | 0,58 |
| 579 | MOTOROLA SOLUTIONS INC | USD | 134.513,28 | 0,02 |
| 2.933 | MSCI INC -A | USD | 1.784.261,22 | 0,22 |
| 676 | M&T BANK CORP | USD | 100.953,84 | 0,01 |
| 5.571 | NASDAQ INC | USD | 1.075.314,42 | 0,13 |
| 1.626 | NETAPP INC | USD | 145.949,76 | 0,02 |
| 8.237 | NETFLIX INC | USD | 5.027.370,58 | 0,62 |
| 1.548 | NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | USD | 148.468,68 | 0,02 |
| 19.978 | NEWELL BRANDS INC | USD | 442.312,92 | 0,05 |
| 34.362 | NEWS CORP - A | USD | 808.537,86 | 0,10 |
| 23.640 | NIKE INC - B | USD | 3.433.237,20 | 0,42 |
| 2.698 | NORDSON CORP | USD | 642.528,70 | 0,08 |
| 8.216 | NORFOLK SOUTHERN CORP | USD | 1.965.678,00 | 0,24 |
| 6.772 | NORTHERN TRUST CORP | USD | 730.089,32 | 0,09 |
| 56.258 | NVIDIA CORP | USD | 11.654.407,28 | 1,43 |
| 7.484 | OKTA INC - A | USD | 1.776.252,56 | 0,22 |
| 6.952 | OMNICOM GROUP INC | USD | 503.741,92 | 0,06 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 30.597 | ON SEMICONDUCTOR CORP | USD | 1.400.424,69 | 0,17 |
| 30.066 | ONEOK INC | USD | 1.743.527,34 | 0,21 |
| 39.306 | ORACLE CORP | USD | 3.424.731,78 | 0,42 |
| 6.628 | OTIS WORLDWIDE CORP | USD | 545.351,84 | 0,07 |
| 4.272 | OWENS CORNING | USD | 365.256,00 | 0,04 |
| 13.011 | PACCAR INC | USD | 1.026.828,12 | 0,13 |
| 3.085 | PACKAGING CORP OF AMERICA | USD | 424.002,40 | 0,05 |
| 2.505 | PALO ALTO NETWORKS INC | USD | 1.199.895,00 | 0,15 |
| 2.098 | PAYCOM SOFTWARE INC | USD | 1.040.083,50 | 0,13 |
| 26.269 | PAYPAL HOLDINGS INC | USD | 6.835.456,49 | 0,84 |
| 27.719 | PEPSICO INC | USD | 4.169.214,79 | 0,51 |
| 2.340 | PERKINELMER INC | USD | 405.498,60 | 0,05 |
| 128.304 | PFIZER INC | USD | 5.518.355,04 | 0,67 |
| 27.433 | PINTEREST INC - A | USD | 1.397.711,35 | 0,17 |
| 12.543 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 2.453.912,52 | 0,30 |
| 2.432 | POOL CORP | USD | 1.056.485,12 | 0,13 |
| 6.785 | PPG INDUSTRIES INC | USD | 970.322,85 | 0,12 |
| 6.971 | PRINCIPAL FINANCIAL GROUP INC | USD | 448.932,40 | 0,06 |
| 67.466 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | USD | 9.431.746,80 | 1,16 |
| 13.520 | PROGRESSIVE CORP/THE | USD | 1.222.072,80 | 0,15 |
| 21.459 | PROLOGIS INC | USD | 2.691.602,37 | 0,33 |
| 15.719 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | USD | 1.653.638,80 | 0,20 |
| 1.639 | PTC INC | USD | 196.335,81 | 0,02 |
| 4.877 | PUBLIC STORAGE | USD | 1.448.956,70 | 0,18 |
| 9.521 | PULTEGROUP INC | USD | 437.204,32 | 0,05 |
| 5.676 | QORVO INC | USD | 948.970,44 | 0,12 |
| 2.097 | QUEST DIAGNOSTICS INC | USD | 304.715,07 | 0,04 |
| 2.766 | RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | USD | 255.246,48 | 0,03 |
| 13.064 | REALTY INCOME CORP | USD | 847.331,04 | 0,10 |
| 13.305 | REGENCY CENTERS CORP | USD | 895.825,65 | 0,11 |
| 2.895 | REGENERON PHARMACEUTICALS INC | USD | 1.751.996,10 | 0,22 |
| 31.706 | REGIONS FINANCIAL CORP | USD | 675.654,86 | 0,08 |
| 525 | REPUBLIC SERVICES INC - A | USD | 63.031,50 | 0,01 |
| 4.864 | RESMED INC | USD | 1.281.907,20 | 0,16 |
| 3.165 | RINGCENTRAL INC - A | USD | 688.387,50 | 0,08 |
| 4.242 | ROBERT HALF INTERNATIONAL INC | USD | 425.599,86 | 0,05 |
| 5.972 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 1.756.006,88 | 0,22 |
| 3.652 | ROKU INC - A | USD | 1.144.354,20 | 0,14 |
| 4.101 | ROPER TECHNOLOGIES INC | USD | 1.829.579,13 | 0,22 |
| 11.071 | ROSS STORES INC | USD | 1.205.078,35 | 0,15 |
| 21.678 | SALESFORCE.COM INC | USD | 5.879.507,16 | 0,72 |
| 1.412 | SBA COMMUNICATIONS CORP - A | USD | 466.764,84 | 0,06 |
| 33.856 | SEMPRA ENERGY | USD | 4.282.784,00 | 0,53 |
| 5.417 | SERVICENOW INC | USD | 3.370.836,59 | 0,41 |
| 8.047 | SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | USD | 2.250.987,31 | 0,28 |
| 37.129 | SNAP INC - A | USD | 2.742.719,23 | 0,34 |
| 790 | SNAP-ON INC | USD | 165.070,50 | 0,02 |
| 1.403 | SOLAREDGE TECHNOLOGIES INC | USD | 372.103,66 | 0,05 |
| 14.096 | SOUTHWEST AIRLINES CO | USD | 724.957,28 | 0,09 |
| 6.549 | S&P GLOBAL INC | USD | 2.782.604,61 | 0,34 |
| 5.740 | SPLUNK INC | USD | 830.635,40 | 0,10 |
| 6.734 | STANLEY BLACK & DECKER INC | USD | 1.180.537,54 | 0,14 |
| 36.447 | STARBUCKS CORP | USD | 4.020.468,57 | 0,49 |
| 11.708 | STATE STREET CORP | USD | 991.901,76 | 0,12 |
| 2.327 | STRYKER CORP | USD | 613.676,44 | 0,08 |
| 13.590 | SUNRUN INC | USD | 597.960,00 | 0,07 |
| 1.235 | SVB FINANCIAL GROUP | USD | 798.896,80 | 0,10 |
| 18.140 | SYNCHRONY FINANCIAL | USD | 886.683,20 | 0,11 |
| 4.365 | SYNOPSYS INC | USD | 1.306.924,65 | 0,16 |
| 21.079 | SYSCO CORP | USD | 1.654.701,50 | 0,20 |
| 5.186 | TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE INC | USD | 799.007,02 | 0,10 |
| 13.258 | TARGET CORP | USD | 3.033.032,66 | 0,37 |
| 3.339 | TELADOC HEALTH INC | USD | 423.418,59 | 0,05 |
| 1.103 | TELEFLEX INC | USD | 415.334,65 | 0,05 |
| 3.830 | TERADYNE INC | USD | 418.121,10 | 0,05 |
| 23.957 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 4.604.774,97 | 0,57 |
| 9.398 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 5.369.359,34 | 0,66 |
| 34.348 | TJX COS INC/THE | USD | 2.266.281,04 | 0,28 |
| 20.865 | T-MOBILE US INC | USD | 2.665.712,40 | 0,33 |
| 5.080 | TRACTOR SUPPLY CO | USD | 1.029.258,80 | 0,13 |
| 13.820 | TRADE DESK INC/THE - A | USD | 971.546,00 | 0,12 |
| 7.001 | TRANSUNION | USD | 786.282,31 | 0,10 |
| 7.367 | TRAVELERS COS INC/THE | USD | 1.119.857,67 | 0,14 |
| 999 | TRIMBLE INC | USD | 82.167,75 | 0,01 |
| 13.559 | TRUIST FINANCIAL CORP | USD | 795.235,35 | 0,10 |
| 6.438 | TWILIO INC - A | USD | 2.054.043,90 | 0,25 |
| 34.820 | TWITTER INC | USD | 2.102.779,80 | 0,26 |
| 74.496 | UGI CORP | USD | 3.175.019,52 | 0,39 |
| 17.310 | UNION PACIFIC CORP | USD | 3.392.933,10 | 0,42 |
| 17.753 | UNITED PARCEL SERVICE INC - B | USD | 3.232.821,30 | 0,40 |
| 3.877 | UNITED RENTALS INC | USD | 1.360.555,61 | 0,17 |
| 20.153 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 7.874.583,22 | 0,97 |
| 47.592 | US BANCORP | USD | 2.828.868,48 | 0,35 |
| 1.694 | VAIL RESORTS INC | USD | 565.880,70 | 0,07 |
| 17.088 | VENTAS INC | USD | 943.428,48 | 0,12 |
| 16.451 | VEREIT INC | USD | 744.078,73 | 0,09 |
| 230 | VERISIGN INC | USD | 47.152,30 | 0,01 |
| 82.368 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 4.448.695,68 | 0,55 |
| 9.131 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 1.656.272,09 | 0,20 |
| 9.580 | VF CORP | USD | 641.764,20 | 0,08 |
| 25.107 | VIACOMCBS INC - B | USD | 991.977,57 | 0,12 |
| 35.203 | VISA INC - A | USD | 7.841.468,25 | 0,96 |
| 2.018 | VMWARE INC - A | USD | 300.076,60 | 0,04 |
| 3.898 | VOYA FINANCIAL INC | USD | 239.298,22 | 0,03 |
| 381 | W R BERKLEY CORP | USD | 27.881,58 | 0,00 |
| 29.451 | WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | USD | 1.385.669,55 | 0,17 |
| 42.974 | WALT DISNEY CO/THE | USD | 7.269.911,58 | 0,89 |
| 7.269 | WASTE MANAGEMENT INC | USD | 1.085.697,84 | 0,13 |
| 510 | WATERS CORP | USD | 182.223,00 | 0,02 |
| 2.040 | WAYFAIR INC - A | USD | 521.240,40 | 0,06 |
| 7.099 | WESTINGHOUSE AIR BRAKE TECHNOLOGIES CORP | USD | 612.004,79 | 0,08 |
| 29.923 | WEYERHAEUSER CO | USD | 1.064.361,11 | 0,13 |
| 1.746 | WHIRLPOOL CORP | USD | 355.939,56 | 0,04 |
| 272 | WORKDAY INC - A | USD | 67.970,08 | 0,01 |
| 2.078 | WW GRAINGER INC | USD | 816.778,68 | 0,10 |
| 8.881 | XILINX INC | USD | 1.340.942,19 | 0,16 |
| 6.128 | XYLEM INC/NY | USD | 757.911,04 | 0,09 |
| 9.370 | YUM! BRANDS INC | USD | 1.146.044,70 | 0,14 |
| 838 | ZEBRA TECHNOLOGIES CORP - A | USD | 431.921,96 | 0,05 |
| 857 | ZENDESK INC | USD | 99.746,23 | 0,01 |
| 6.303 | ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | USD | 922.507,08 | 0,11 |
| 12.720 | ZOETIS INC - A | USD | 2.469.460,80 | 0,30 |
| 4.896 | ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS INC - A | USD | 1.280.304,00 | 0,16 |
| 2.428 | ZSCALER INC | USD | 636.670,16 | 0,08 |
| 16.086 | 3M CO | USD | 2.821.806,12 | 0,35 |
| | | | **729.366.502,58** | **89,56** |
| | **Kanada** | | | |
| 23.840 | BALLARD POWER SYSTEMS INC | CAD | 334.589,89 | 0,04 |
| 12.923 | BANK OF MONTREAL | CAD | 1.289.902,79 | 0,16 |
| 18.087 | BANK OF NOVA SCOTIA/THE | CAD | 1.113.046,15 | 0,14 |
| 21.557 | BCE INC | CAD | 1.079.679,24 | 0,13 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 25.787 | BLACKBERRY LTD | CAD | 250.979,76 | 0,03 |
| 1.569 | CANADIAN IMPERIAL BANK OF COMMERCE | CAD | 174.629,20 | 0,02 |
| 21.560 | CANADIAN NATIONAL RAILWAY CO | CAD | 2.497.988,55 | 0,31 |
| 16.428 | CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | CAD | 1.072.549,93 | 0,13 |
| 1.615 | CANADIAN TIRE CORP LTD - A | CAD | 225.948,30 | 0,03 |
| 11.916 | EMPIRE CO LTD - A | CAD | 363.071,87 | 0,04 |
| 2.470 | GEORGE WESTON LTD | CAD | 266.370,45 | 0,03 |
| 7.753 | GILDAN ACTIVEWEAR INC - A | CAD | 283.229,14 | 0,03 |
| 194.583 | HYDRO ONE LTD | CAD | 4.598.662,05 | 0,56 |
| 1.788 | INTACT FINANCIAL CORP | CAD | 236.377,03 | 0,03 |
| 59.253 | KEYERA CORP | CAD | 1.490.620,92 | 0,18 |
| 29.025 | KIRKLAND LAKE GOLD LTD | CAD | 1.208.792,67 | 0,15 |
| 9.239 | LOBLAW COS LTD | CAD | 633.898,16 | 0,08 |
| 98.582 | LUNDIN MINING CORP | CAD | 708.909,52 | 0,09 |
| 26.111 | MANULIFE FINANCIAL CORP | CAD | 502.495,31 | 0,06 |
| 20.757 | METRO INC | CAD | 1.014.051,17 | 0,12 |
| 1.669 | NATIONAL BANK OF CANADA | CAD | 128.160,65 | 0,02 |
| 23.178 | NUTRIEN LTD | CAD | 1.504.095,50 | 0,18 |
| 65.682 | PEMBINA PIPELINE CORP | CAD | 2.081.645,26 | 0,26 |
| 3.177 | RITCHIE BROS AUCTIONEERS INC | CAD | 196.009,25 | 0,02 |
| 16.849 | ROGERS COMMUNICATIONS INC - B | CAD | 786.690,10 | 0,10 |
| 38.490 | ROYAL BANK OF CANADA | CAD | 3.829.099,50 | 0,47 |
| 50.347 | SHAW COMMUNICATIONS INC - B | CAD | 1.463.296,00 | 0,18 |
| 3.401 | SHOPIFY INC - A | CAD | 4.615.437,68 | 0,57 |
| 45.568 | TELUS CORP | CAD | 1.001.391,74 | 0,12 |
| 7.252 | THOMSON REUTERS CORP | CAD | 801.707,07 | 0,10 |
| 39.329 | TORONTO-DOMINION BANK/THE | CAD | 2.603.099,54 | 0,32 |
| 904 | WEST FRASER TIMBER CO LTD | CAD | 76.124,81 | 0,01 |
| 40.138 | WHEATON PRECIOUS METALS CORP | CAD | 1.510.660,17 | 0,19 |
| 4.006 | WSP GLOBAL INC | CAD | 479.575,29 | 0,06 |
| 155.210 | YAMANA GOLD INC | CAD | 612.582,39 | 0,08 |
| | | | **41.035.367,05** | **5,04** |
| | **Irland** | | | |
| 13.414 | ACCENTURE PLC - A | USD | 4.291.406,88 | 0,53 |
| 1.142 | ALLEGION PLC | USD | 150.949,56 | 0,02 |
| 6.170 | AON PLC - A | USD | 1.763.200,90 | 0,22 |
| 6.556 | HORIZON THERAPEUTICS PLC | USD | 718.144,24 | 0,09 |
| 20.333 | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | USD | 1.384.270,64 | 0,17 |
| 16.110 | LINDE PLC | USD | 4.726.351,80 | 0,58 |
| 33.324 | MEDTRONIC PLC | USD | 4.177.163,40 | 0,51 |
| 5.346 | PENTAIR PLC | USD | 388.279,98 | 0,05 |
| 2.378 | STERIS PLC | USD | 485.777,84 | 0,06 |
| 6.600 | TRANE TECHNOLOGIES PLC | USD | 1.139.490,00 | 0,14 |
| 3.669 | WILLIS TOWERS WATSON PLC | USD | 852.895,74 | 0,10 |
| | | | **20.077.930,98** | **2,47** |
| | **Bermuda** | | | |
| 9.121 | ARCH CAPITAL GROUP LTD | USD | 348.239,78 | 0,04 |
| 4.509 | ATHENE HOLDING LTD - A | USD | 310.534,83 | 0,04 |
| 14.979 | BUNGE LTD | USD | 1.218.092,28 | 0,15 |
| 635 | EVEREST RE GROUP LTD | USD | 159.245,30 | 0,02 |
| 20.076 | IHS MARKIT LTD | USD | 2.341.263,12 | 0,28 |
| 16.837 | INVESCO LTD | USD | 405.940,07 | 0,05 |
| 414 | RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | USD | 57.711,60 | 0,01 |
| | | | **4.841.026,98** | **0,59** |
| | **Schweiz** | | | |
| 13.271 | CHUBB LTD | USD | 2.302.253,08 | 0,28 |
| 8.791 | GARMIN LTD | USD | 1.366.648,86 | 0,17 |
| 2.748 | TE CONNECTIVITY LTD | USD | 377.080,56 | 0,05 |
| | | | **4.045.982,50** | **0,50** |
| | **Curacao** | | | |
| 130.065 | SCHLUMBERGER NV | USD | 3.855.126,60 | 0,47 |
| | | | **3.855.126,60** | **0,47** |
| | **Niederlande** | | | |
| 12.879 | LYONDELLBASELL INDUSTRIES NV - A | USD | 1.208.694,15 | 0,15 |
| 10.425 | NXP SEMICONDUCTORS NV | USD | 2.041.944,75 | 0,25 |
| | | | **3.250.638,90** | **0,40** |
| | **Jersey** | | | |
| 20.612 | APTIV PLC | USD | 3.070.569,64 | 0,38 |
| | | | **3.070.569,64** | **0,38** |
| | **Panama** | | | |
| 46.697 | CARNIVAL CORP | USD | 1.167.891,97 | 0,14 |
| | | | **1.167.891,97** | **0,14** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 17.010 | LIBERTY GLOBAL PLC - C | USD | 501.114,60 | 0,06 |
| 11.564 | SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING PLC | USD | 632.782,08 | 0,08 |
| | | | **1.133.896,68** | **0,14** |
| | **Liberia** | | | |
| 10.822 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD | USD | 962.616,90 | 0,12 |
| | | | **962.616,90** | **0,12** |
| | | | **812.807.550,78** | **99,81** |
| | **Wertpapierbestand Gesamt** | | **812.807.550,78** | **99,81** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | Zu zahlen | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| | **Devisentermingeschäft** | | | |
| 2.099,97 EUR | 2.491,66 USD | 19/10/2021 | 2.491,66 | (57,18) |
| | | | **2.491,66** | **(57,18)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(57,18)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **812.807.550,78** | **99,81** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(57,18)** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **1.908.459,22** | **0,23** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(363.565,08)** | **(0,04)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **814.352.387,74** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Smart Connectivity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen(1)** | 30.09.2021 | EUR | 802.597.724,56 |
| | 30.09.2020 | EUR | 173.158.355,53 |
| | 30.09.2019 | USD | 222.012.211,86 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.774,03 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.392,98 |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 3.123,34 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.515,91 |
| | 30.09.2019 | USD | 2.080,94 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 9.138,30 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 1.894,64 |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.523,35 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.368,75 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.662,48 |
| | 30.09.2020 | USD | 2.166,00 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.809,37 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 130,99 |
| | 30.09.2020 | EUR | 107,91 |
| | 30.09.2019 | EUR | 92,38 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 451,72 |
| | 30.09.2020 | EUR | 360,49 |
| | 30.09.2019 | EUR | 320,34 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 418,33 |
| | 30.09.2020 | USD | 337,78 |
| | 30.09.2019 | USD | 280,04 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 391,08 |
| | 30.09.2020 | EUR | 319,83 |
| | 30.09.2019 | EUR | 271,88 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.116,84 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.749,91 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.191,72 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | HUF | 268.353,95 |
| | 30.09.2020 | HUF | 219.229,29 |
| | 30.09.2019 | HUF | 182.584,54 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.400,66 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.962,35 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.647,11 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 8.533,33 |
| | 30.09.2020 | CZK | 6.879,12 |
| | 30.09.2019 | CZK | - |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 63,09 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 12.725,16 |
| | 30.09.2020 | USD | 10.352,26 |
| | 30.09.2019 | USD | 8.649,24 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 514,91 |
| | 30.09.2020 | EUR | 424,01 |
| | 30.09.2019 | EUR | 363,09 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 413,54 |
| | 30.09.2020 | USD | 333,92 |
| | 30.09.2019 | USD | 276,94 |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 387,12 |
| | 30.09.2020 | EUR | 316,52 |
| | 30.09.2019 | EUR | 268,94 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 516 |
| | 30.09.2020 | 97 |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 20.244 |
| | 30.09.2020 | 20.918 |
| | 30.09.2019 | 29.050 |
| Capitalisation I Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 5.539 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1.625 |
| | 30.09.2020 | 1.779 |
| | 30.09.2019 | 2.100 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 22.496 |
| | 30.09.2020 | 26.027 |
| | 30.09.2019 | 22.360 |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 217.786 |
| | 30.09.2020 | 270.508 |
| | 30.09.2019 | 170.775 |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 77 |
| | 30.09.2020 | 77 |
| | 30.09.2019 | 368 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 2.604 |
| | 30.09.2020 | 2.980 |
| | 30.09.2019 | 6.904 |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1.666 |
| | 30.09.2020 | 1.871 |
| | 30.09.2019 | 1.555 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

(1) Am 1. Dezember 2019 wurde die Basiswährung des Teilfonds NN (L) Smart Connectivity von USD auf EUR umgestellt.
** Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Smart Connectivity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2.304 |
| | 30.09.2020 | 2.709 |
| | 30.09.2019 | 3.501 |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 4.327 |
| | 30.09.2020 | 6.745 |
| | 30.09.2019 | 7.240 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 7.844 |
| | 30.09.2020 | 7.761 |
| | 30.09.2019 | 6.019 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 11.740 |
| | 30.09.2020 | 4.350 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 9.632.077 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 532 |
| | 30.09.2020 | 674 |
| | 30.09.2019 | 507 |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 10.920 |
| | 30.09.2020 | 13.822 |
| | 30.09.2019 | 9.758 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1.565 |
| | 30.09.2020 | 1.648 |
| | 30.09.2019 | 2.011 |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 242 |
| | 30.09.2020 | 880 |
| | 30.09.2019 | 787 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,07% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (HUF) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution R Hedged (ii) (EUR) | 30.09.2021 | 1,06% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 20,07% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

(1) Am 1. Dezember 2019 wurde die Basiswährung des Teilfonds NN (L) Smart Connectivity von USD auf EUR umgestellt.
** Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Smart Connectivity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **800.215.791,06** |
| Aktien | | 800.215.791,06 |
| **Bankguthaben** | | **4.587.626,87** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **1.906.455,81** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***806.709.873,74*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(3.622.236,88)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(489.912,30)** |
| Devisentermingeschäfte | | (489.912,30) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(4.112.149,18)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***802.597.724,56*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **5.111.049,53** |
| Dividenden | | 4.965.428,64 |
| Sonstige Erträge | 10 | 145.620,89 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(7.584.199,97)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (5.630.427,58) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.536.023,35) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (8.002,93) |
| Abonnementsteuer | 9 | (354.943,46) |
| Bankzinsen | | (54.802,65) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(2.473.150,44)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 33.759.880,81 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (8.055.709,65) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 120.199,84 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (624.038,27) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 2.355.501,73 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (2.290.080,94) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 147.249.210,93 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (42.496,24) |
| **Ergebnis** | | **169.999.317,77** |
| Zeichnungen | | 610.520.655,32 |
| Rücknahmen | | (151.080.604,06) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 173.158.355,53 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***802.597.724,56*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Smart Connectivity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 36.000 | ADOBE INC | USD | 17.883.359,94 | 2,23 |
| 85.000 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 19.465.766,43 | 2,43 |
| 113.000 | ANSYS INC | USD | 33.194.572,67 | 4,14 |
| 172.320 | BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS INC | USD | 24.777.086,85 | 3,09 |
| 137.140 | IDEX CORP | USD | 24.488.651,80 | 3,05 |
| 90.000 | INTUIT INC | USD | 41.896.458,00 | 5,22 |
| 108.000 | MASTERCARD INC - A | USD | 32.399.534,06 | 4,04 |
| 175.400 | MICROSOFT CORP | USD | 42.666.869,15 | 5,32 |
| 68.000 | PAYCOM SOFTWARE INC | USD | 29.087.536,13 | 3,62 |
| 120.000 | PAYPAL HOLDINGS INC | USD | 26.942.663,62 | 3,36 |
| 264.000 | TRANSUNION | USD | 25.583.364,25 | 3,18 |
| 86.500 | VEEVA SYSTEMS INC - A | USD | 21.508.007,25 | 2,68 |
| 156.980 | VERISK ANALYTICS INC - A | USD | 27.126.609,95 | 3,38 |
| 182.000 | VISA INC - A | USD | 34.980.370,16 | 4,35 |
| | | | **402.000.850,26** | **50,09** |
| **Vereinigtes Königreich** | | | | |
| 2.500.000 | GB GROUP PLC | GBP | 25.159.037,96 | 3,13 |
| 1.100.000 | HALMA PLC | GBP | 36.370.952,36 | 4,53 |
| 9.300.000 | HELIOS TOWERS PLC | GBP | 19.583.911,49 | 2,44 |
| 177.820 | INTERTEK GROUP PLC | GBP | 10.296.417,90 | 1,28 |
| 1.475.000 | RELX PLC | GBP | 36.843.593,25 | 4,59 |
| 1.250.000 | RWS HOLDINGS PLC | GBP | 9.111.062,01 | 1,14 |
| | | | **137.364.974,97** | **17,11** |
| **Niederlande** | | | | |
| 5.000 | ADYEN NV | EUR | 12.075.000,00 | 1,50 |
| 250.000 | ALFEN BEHEER BV | EUR | 22.750.000,00 | 2,84 |
| 45.000 | ASML HOLDING NV | EUR | 29.065.500,00 | 3,62 |
| | | | **63.890.500,00** | **7,96** |
| **Japan** | | | | |
| 36.508 | KEYENCE CORP | JPY | 18.859.771,16 | 2,35 |
| 675.000 | SMS CO LTD | JPY | 21.260.300,95 | 2,65 |
| | | | **40.120.072,11** | **5,00** |
| **Kanada** | | | | |
| 530.000 | DESCARTES SYSTEMS GROUP INC | CAD | 37.217.280,24 | 4,64 |
| | | | **37.217.280,24** | **4,64** |
| **Irland** | | | | |
| 128.000 | ACCENTURE PLC - A | USD | 35.333.500,15 | 4,40 |
| | | | **35.333.500,15** | **4,40** |
| **Dänemark** | | | | |
| 279.000 | NETCOMPANY GROUP AS | DKK | 27.783.914,47 | 3,46 |
| | | | **27.783.914,47** | **3,46** |
| **Kaimaninseln** | | | | |
| 330.000 | ARCO PLATFORM LTD - A | USD | 6.178.868,80 | 0,77 |
| 328.850 | PAGSEGURO DIGITAL LTD - A | USD | 14.675.457,96 | 1,83 |
| | | | **20.854.326,76** | **2,60** |
| **Schweiz** | | | | |
| 55.000 | SIKA AG - REG | CHF | 15.099.065,23 | 1,88 |
| | | | **15.099.065,23** | **1,88** |
| **Frankreich** | | | | |
| 150.000 | LEGRAND SA | EUR | 13.914.000,00 | 1,73 |
| | | | **13.914.000,00** | **1,73** |
| **Kenia** | | | | |
| 20.000.000 | SAFARICOM PLC | KES | 6.637.306,87 | 0,83 |
| | | | **6.637.306,87** | **0,83** |
| | | | **800.215.791,06** | **99,70** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **800.215.791,06** | **99,70** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 101.109.482,53 | CZK | 3.978.295,09 | EUR | 19/10/2021 | 3.978.295,09 | 8.028,51 |
| 6.314.931,49 | EUR | 5.424.538,39 | GBP | 19/10/2021 | 6.314.931,49 | 5.641,34 |
| 1.169.129,87 | USD | 1.004.034,47 | EUR | 19/10/2021 | 1.004.034,47 | 4.451,63 |
| 7.235.505,08 | SEK | 712.003,47 | EUR | 19/10/2021 | 712.003,47 | 1.487,19 |
| 110.185,69 | CAD | 74.455,12 | EUR | 19/10/2021 | 74.455,12 | 568,19 |
| 1.429.717,80 | EUR | 10.628.025,67 | DKK | 19/10/2021 | 1.429.717,80 | 468,99 |
| 17.030.010,00 | JPY | 131.282,11 | EUR | 19/10/2021 | 131.282,11 | 392,14 |
| 52.675,60 | CHF | 48.652,35 | EUR | 19/10/2021 | 48.652,35 | 74,97 |
| 6.103,35 | GBP | 7.077,72 | EUR | 19/10/2021 | 7.077,72 | 21,10 |
| 38,37 | EUR | 13.396,60 | HUF | 19/10/2021 | 38,37 | 1,11 |
| 602,64 | EUR | 52.379,64 | INR | 21/10/2021 | 602,64 | (5,20) |
| 4.706,74 | EUR | 119.576,53 | CZK | 19/10/2021 | 4.706,74 | (7,66) |
| 888,34 | EUR | 3.369,37 | ILS | 19/10/2021 | 888,34 | (12,63) |
| 1.914,67 | EUR | 48.846,08 | CZK | 01/10/2021 | 1.914,67 | (12,73) |
| 1.264.461,51 | DKK | 170.060,46 | EUR | 19/10/2021 | 170.060,46 | (16,63) |
| 4.307,11 | EUR | 109.824,76 | CZK | 04/10/2021 | 4.307,11 | (26,43) |
| 2.523,69 | EUR | 25.923,79 | NOK | 19/10/2021 | 2.523,69 | (37,72) |
| 709.942,03 | EUR | 7.243.147,31 | SEK | 19/10/2021 | 709.942,03 | (4.302,21) |
| 710.825,37 | EUR | 774.721,11 | CHF | 19/10/2021 | 710.825,37 | (5.826,84) |
| 1.873.432,73 | EUR | 244.245.005,00 | JPY | 19/10/2021 | 1.873.432,73 | (15.044,00) |
| 1.691.771,68 | EUR | 2.522.377,79 | CAD | 19/10/2021 | 1.691.771,68 | (25.666,75) |
| 21.046.328,78 | EUR | 24.932.217,69 | USD | 19/10/2021 | 21.046.328,78 | (460.088,67) |
| | | | | | **39.917.792,23** | **(489.912,30)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(489.912,30)** |

(1) Am 1. Dezember 2019 wurde die Basiswährung des Teilfonds NN (L) Smart Connectivity von USD auf EUR umgestellt.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Smart Connectivity

*(ausgedrückt in EUR)*

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **800.215.791,06** | **99,70** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(489.912,30)** | **(0,06)** |
| **Bankguthaben** | **4.587.626,87** | **0,57** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(1.715.781,07)** | **(0,21)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **802.597.724,56** | **100,00** |

(1) Am 1. Dezember 2019 wurde die Basiswährung des Teilfonds NN (L) Smart Connectivity von USD auf EUR umgestellt.

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Sovereign Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | EUR | 171.922.132,25 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 9.896,93 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4,94 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4,95 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 247,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 4.210,46 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 98,51 |
| | 30.09.2020 | GBP | - |
| | 30.09.2019 | GBP | - |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 14.112 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | | 5.000 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | | 5.000 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | | 8 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | | 6.638 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Distribution R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | | 37.137 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |

| | | |
|---|---|---|
| **Laufende Kosten in %*** | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,33% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 0,60% |
| Capitalisation R (EUR) | 30.09.2021 | 0,40% |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation Z (EUR) | 30.09.2021 | 0,13% |
| Distribution R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,33% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 7,83% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17). Dieser Teilfonds wurde im Jahresverlauf aufgelegt. Die Daten zur Berechnung der Portfolioumschlagsrate basieren auf den Informationen für den Zeitraum ab der Auflegung des Teilfonds bis zum 30. September 2021.
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) Sovereign Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **169.350.193,94** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 169.350.193,94 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **124.984,55** |
| Futures | | 124.984,55 |
| **Bankguthaben** | | **4.232.127,28** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **69.518,41** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **4.012.950,34** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***177.789.774,52*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(5.851.569,88)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(16.072,39)** |
| Devisentermingeschäfte | | (16.072,39) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(5.867.642,27)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums*** | | ***171.922.132,25*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für den Zeitraum vom 01.04.2021 bis 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **228.786,02** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 228.786,02 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(237.124,32)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (119.167,68) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (95.687,52) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (53,44) |
| Abonnementsteuer | 9 | (7.998,63) |
| Bankzinsen | | (14.217,05) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(8.338,30)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 10.447,43 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (121.393,72) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 488.884,82 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (733.037,46) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 48.501,65 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (7.859,84) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (1.749.685,72) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 108.912,16 |
| **Ergebnis** | | **(1.963.568,98)** |
| Zeichnungen | | 189.355.893,22 |
| Rücknahmen | | (15.470.191,99) |
| Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | - |
| ***Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums*** | | ***171.922.132,25*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Sovereign Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| | **Frankreich** | | | |
| 1.100.000 | ELECTRICITE DE FRANCE SA 1.000% 13/10/2026 EMTN | EUR | 1.148.524,61 | 0,67 |
| 5.500.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 0.500% 25/06/2044 | EUR | 5.251.115,10 | 3,05 |
| 15.300.000 | FRANCE GOVERNMENT BOND OAT 1.750% 25/06/2039 | EUR | 18.528.533,02 | 10,78 |
| 2.000.000 | LA BANQUE POSTALE SA 1.375% 24/04/2029 EMTN | EUR | 2.122.403,36 | 1,23 |
| 700.000 | LA POSTE SA 1.450% 30/11/2028 EMTN | EUR | 762.155,55 | 0,44 |
| 2.100.000 | REGIE AUTONOME DES TRANSPORTS PARISIENS 0.875% 25/05/2027 EMTN | EUR | 2.212.250,25 | 1,29 |
| 3.600.000 | SNCF RESEAU 0.750% 25/05/2036 EMTN | EUR | 3.661.232,87 | 2,13 |
| 1.100.000 | SNCF RESEAU 1.000% 09/11/2031 EMTN | EUR | 1.168.982,43 | 0,68 |
| 6.800.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 0.700% 15/10/2060 EMTN | EUR | 5.779.053,71 | 3,36 |
| 3.500.000 | SOCIETE DU GRAND PARIS EPIC 1.125% 25/05/2034 EMTN | EUR | 3.761.682,89 | 2,19 |
| 1.700.000 | SOCIETE NATIONALE SNCF SA 0.625% 17/04/2030 EMTN | EUR | 1.754.473,22 | 1,02 |
| | | | **46.150.407,01** | **26,84** |
| | **Deutschland** | | | |
| 2.500.000 | BUNDESREPUBLIK DEUTSCHLAND BUNDESANLEIHE ZCP 15/08/2050 | EUR | 2.339.658,45 | 1,36 |
| 4.000.000 | DEUTSCHE KREDITBANK AG 0.010% 23/02/2026 | EUR | 4.000.475,64 | 2,33 |
| 1.800.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 05/11/2079 FRN | EUR | 1.820.230,45 | 1,06 |
| 600.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 29/06/2080 FRN | EUR | 620.171,80 | 0,36 |
| 1.000.000 | ENBW ENERGIE BADEN-WUERTTEMBERG AG 31/08/2081 FRN | EUR | 988.212,76 | 0,57 |
| 4.000.000 | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU ZCP 15/06/2029 EMTN | EUR | 4.040.008,40 | 2,35 |
| 7.800.000 | KREDITANSTALT FUER WIEDERAUFBAU ZCP 15/09/2028 EMTN | EUR | 7.907.652,17 | 4,60 |
| 2.000.000 | LANDESBANK BADEN-WUERTTEMBERG 0.375% 29/07/2026 EMTN | EUR | 2.031.558,98 | 1,18 |
| 6.500.000 | LANDWIRTSCHAFTLICHE RENTENBANK ZCP 30/06/2031 EMTN | EUR | 6.477.439,87 | 3,77 |
| 4.000.000 | NRW BANK 0.625% 02/02/2029 EMTN | EUR | 4.191.141,20 | 2,44 |
| | | | **34.416.549,72** | **20,02** |
| | **Niederlande** | | | |
| 3.200.000 | ALLIANDER NV 0.375% 10/06/2030 EMTN | EUR | 3.228.089,12 | 1,88 |
| 2.000.000 | ALLIANDER NV 0.875% 22/04/2026 EMTN | EUR | 2.085.971,68 | 1,21 |
| 1.500.000 | ENBW INTERNATIONAL FINANCE BV 1.875% 31/10/2033 EMTN | EUR | 1.713.443,18 | 1,00 |
| 2.500.000 | NEDERLANDSE WATERSCHAPSBANK NV 0.500% 26/04/2051 EMTN | EUR | 2.445.354,30 | 1,42 |
| 3.000.000 | NETHERLANDS GOVERNMENT BOND 0.500% 15/01/2040 | EUR | 3.166.332,21 | 1,84 |
| 2.800.000 | SWISSCOM FINANCE BV 0.375% 14/11/2028 | EUR | 2.837.260,50 | 1,65 |
| 500.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 524.001,75 | 0,30 |
| 600.000 | TENNET HOLDING BV FRN PERP | EUR | 632.314,29 | 0,37 |
| 1.000.000 | TENNET HOLDING BV 0.500% 30/11/2040 EMTN | EUR | 906.364,46 | 0,53 |
| 500.000 | TENNET HOLDING BV 1.000% 13/06/2026 EMTN | EUR | 523.189,44 | 0,30 |
| 1.000.000 | TENNET HOLDING BV 1.375% 26/06/2029 EMTN | EUR | 1.080.712,48 | 0,63 |
| 1.500.000 | TENNET HOLDING BV 1.500% 03/06/2039 EMTN | EUR | 1.621.437,27 | 0,94 |
| 1.500.000 | TENNET HOLDING BV 1.875% 13/06/2036 EMTN | EUR | 1.711.414,76 | 1,00 |
| | | | **22.475.885,44** | **13,07** |
| | **Italien** | | | |
| 1.500.000 | ACEA SPA ZCP 28/09/2025 EMTN | EUR | 1.500.801,51 | 0,87 |
| 500.000 | ACEA SPA 0.250% 28/07/2030 EMTN | EUR | 484.555,18 | 0,28 |
| 894.000 | FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 0.875% 07/12/2023 EMTN | EUR | 915.590,61 | 0,53 |
| 3.079.000 | FERROVIE DELLO STATO ITALIANE SPA 1.125% 09/07/2026 EMTN | EUR | 3.237.633,13 | 1,88 |
| 5.700.000 | ITALY BUONI POLIENNALI DEL TESORO 1.500% 30/04/2045 | EUR | 5.549.301,86 | 3,24 |
| | | | **11.687.882,29** | **6,80** |
| | **Irland** | | | |
| 9.000.000 | IRELAND GOVERNMENT BOND 1.350% 18/03/2031 | EUR | 10.084.014,54 | 5,87 |
| | | | **10.084.014,54** | **5,87** |
| | **Belgien** | | | |
| 8.200.000 | BELGIUM GOVERNMENT BOND 1.250% 22/04/2033 | EUR | 9.218.414,50 | 5,36 |
| | | | **9.218.414,50** | **5,36** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 4.000.000 | EUROFIMA 0.150% 10/10/2034 EMTN | EUR | 3.842.008,92 | 2,24 |
| 1.000.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 0.010% 15/11/2035 | EUR | 957.326,95 | 0,56 |
| 2.800.000 | EUROPEAN INVESTMENT BANK 1.500% 15/11/2047 | EUR | 3.417.479,32 | 1,99 |
| | | | **8.216.815,19** | **4,79** |
| | **Schweden** | | | |
| 2.400.000 | SBAB BANK AB 0.500% 13/05/2025 EMTN | EUR | 2.457.367,34 | 1,44 |
| 2.000.000 | VATTENFALL AB 0.125% 12/02/2029 EMTN | EUR | 1.966.007,08 | 1,14 |
| 1.000.000 | VATTENFALL AB 0.500% 24/06/2026 EMTN | EUR | 1.020.043,20 | 0,59 |
| | | | **5.443.417,62** | **3,17** |
| | **Dänemark** | | | |
| 1.000.000 | KOMMUNEKREDIT 0.125% 26/09/2040 EMTN | EUR | 910.549,21 | 0,53 |
| 450.000 | KOMMUNEKREDIT 0.625% 21/11/2039 | EUR | 452.962,17 | 0,26 |
| 1.000.000 | KOMMUNEKREDIT 0.750% 18/05/2027 EMTN | EUR | 1.052.626,28 | 0,61 |
| 500.000 | ORSTED AS 09/12/3019 FRN | EUR | 515.115,61 | 0,30 |
| 1.100.000 | ORSTED AS 1.500% 26/11/2029 | EUR | 1.198.102,55 | 0,70 |
| 700.000 | ORSTED AS 18/02/3021 FRN | EUR | 699.064,29 | 0,41 |
| 300.000 | ORSTED AS 24/11/3017 FRN | EUR | 314.281,62 | 0,18 |
| | | | **5.142.701,73** | **2,99** |
| | **Spanien** | | | |
| 500.000 | ADIF ALTA VELOCIDAD 0.550% 30/04/2030 EMTN | EUR | 507.439,26 | 0,30 |
| 1.500.000 | ADIF ALTA VELOCIDAD 0.550% 31/10/2031 | EUR | 1.494.129,32 | 0,86 |
| 1.000.000 | ADIF ALTA VELOCIDAD 1.250% 04/05/2026 EMTN | EUR | 1.063.801,88 | 0,62 |
| 1.000.000 | INSTITUTO DE CREDITO OFICIAL ZCP 30/04/2027 EMTN | EUR | 1.007.244,15 | 0,59 |
| 774.000 | SPAIN GOVERNMENT BOND 1.000% 30/07/2042 | EUR | 764.118,13 | 0,44 |
| | | | **4.836.732,74** | **2,81** |
| | **Chile** | | | |
| 2.500.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 0.830% 02/07/2031 | EUR | 2.494.113,73 | 1,45 |
| 1.100.000 | CHILE GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.250% 29/01/2040 | EUR | 1.062.875,00 | 0,62 |
| | | | **3.556.988,73** | **2,07** |
| | **Ungarn** | | | |
| 2.000.000 | HUNGARY GOVERNMENT INTERNATIONAL BOND 1.750% 05/06/2035 | EUR | 2.100.563,02 | 1,22 |
| | | | **2.100.563,02** | **1,22** |
| | **China** | | | |
| 2.000.000 | CHINA DEVELOPMENT BANK 0.375% 16/11/2021 EMTN | EUR | 1.999.949,40 | 1,16 |
| | | | **1.999.949,40** | **1,16** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) Sovereign Green Bond

*(ausgedrückt in EUR)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in EUR | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| | **Südkorea** | | | |
| 2.000.000 | KOREA INTERNATIONAL BOND 2.000% 19/06/2024 | USD | 1.792.700,13 | 1,04 |
| | | | **1.792.700,13** | **1,04** |
| | **Österreich** | | | |
| 1.000.000 | VERBUND AG 0.900% 01/04/2041 | EUR | 1.005.272,11 | 0,58 |
| | | | **1.005.272,11** | **0,58** |
| | **Litauen** | | | |
| 800.000 | AB IGNITIS GRUPE 2.000% 14/07/2027 EMTN | EUR | 876.322,46 | 0,51 |
| | | | **876.322,46** | **0,51** |
| | **Indien** | | | |
| 344.000 | POWER FINANCE CORP LTD 1.841% 21/09/2028 GMTN | EUR | 345.577,31 | 0,20 |
| | | | **345.577,31** | **0,20** |
| | | | **169.350.193,94** | **98,50** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **169.350.193,94** | **98,50** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 3.711.468,25 | GBP | 4.316.457,71 | EUR | 19/10/2021 | 4.316.457,71 | 357,55 |
| 22.057,10 | EUR | 19.023,15 | GBP | 01/10/2021 | 22.057,10 | (74,89) |
| 155.226,84 | EUR | 134.310,02 | GBP | 04/10/2021 | 155.226,84 | (1.032,64) |
| 1.818.202,81 | EUR | 2.126.000,00 | USD | 29/10/2021 | 1.818.202,81 | (15.322,41) |
| | | | | | **6.311.944,46** | **(16.072,39)** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in EUR | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in EUR |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| 28 | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 3.778.040,00 | (28.280,00) |
| (122) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 20.718.040,00 | 384.190,00 |
| 34 | EURO-BUXL 30Y BOND 08/12/2021 | EUR | 6.913.560,00 | (237.080,00) |
| (11) | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 1.164.989,06 | 6.154,55 |
| | | | **32.574.629,06** | **124.984,55** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **108.912,16** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **169.350.193,94** | **98,50** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **108.912,16** | **0,06** |
| **Bankguthaben** | **4.232.127,28** | **2,46** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **(1.769.101,13)** | **(1,02)** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **171.922.132,25** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Behavioural Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 37.307.525,96 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.091,07 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 253,56 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 254,32 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 5.359,12 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 6 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 19 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | | 19 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | | 6.000 |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | - |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 0,81% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 1,80% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | | 1,05% |
| Distribution Z (EUR) | 30.09.2021 | | 0,21% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 125,07% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17). Dieser Teilfonds wurde im Jahresverlauf aufgelegt. Die Daten zur Berechnung der Portfolioumschlagsrate basieren auf den Informationen für den Zeitraum ab der Auflegung des Teilfonds bis zum 30. September 2021.
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US Behavioural Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **37.142.401,43** |
| Aktien | | 37.142.401,43 |
| **Bankguthaben** | | **140.481,40** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **31.996,30** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***37.314.879,13*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(7.353,17)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(7.353,17)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums*** | | ***37.307.525,96*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für den Zeitraum vom 11.05.2021 bis 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **151.949,15** |
| Dividenden | | 151.949,15 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(31.572,74)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (119,99) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (29.572,09) |
| Abonnementsteuer | 9 | (1.880,66) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **120.376,41** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 923.945,37 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (684.198,10) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 94.500,99 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (129.000,74) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 427.802,28 |
| **Ergebnis** | | **753.426,21** |
| Zeichnungen | | 36.554.099,75 |
| Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | - |
| ***Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums*** | | ***37.307.525,96*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Behavioural Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Aktien

#### Vereinigte Staaten

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 5.206 | ABBOTT LABORATORIES | USD | 614.984,78 | 1,65 |
| 1.357 | ADOBE INC | USD | 781.252,04 | 2,09 |
| 146 | ADVANCED ENERGY INDUSTRIES INC | USD | 12.811,50 | 0,03 |
| 3.861 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | USD | 397.296,90 | 1,06 |
| 900 | ALLEGRO MICROSYSTEMS INC | USD | 28.764,00 | 0,08 |
| 2.042 | ALLSTATE CORP/THE | USD | 259.967,02 | 0,70 |
| 642 | ALPHABET INC - A | USD | 1.716.399,84 | 4,60 |
| 270 | AMAZON.COM INC | USD | 886.960,80 | 2,38 |
| 3.200 | AMC ENTERTAINMENT HOLDINGS INC - A | USD | 121.792,00 | 0,33 |
| 591 | AMEDISYS INC | USD | 88.118,10 | 0,24 |
| 426 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 113.064,66 | 0,30 |
| 2.300 | APOLLO MEDICAL HOLDINGS INC | USD | 209.415,00 | 0,56 |
| 12.358 | APPLE INC | USD | 1.748.657,00 | 4,70 |
| 792 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 101.954,16 | 0,27 |
| 2.300 | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | USD | 138.023,00 | 0,37 |
| 300 | ARROW ELECTRONICS INC | USD | 33.687,00 | 0,09 |
| 362 | AUTOLIV INC | USD | 31.030,64 | 0,08 |
| 1.005 | AUTONATION INC | USD | 122.368,80 | 0,33 |
| 452 | AVERY DENNISON CORP | USD | 93.658,92 | 0,25 |
| 2.600 | BAKER HUGHES CO - A | USD | 64.298,00 | 0,17 |
| 16.700 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 708.915,00 | 1,91 |
| 506 | BERKSHIRE HATHAWAY INC - B | USD | 138.107,64 | 0,37 |
| 300 | BERRY GLOBAL GROUP INC | USD | 18.264,00 | 0,05 |
| 148 | BIO-RAD LABORATORIES INC - A | USD | 110.400,60 | 0,30 |
| 100 | BLACKROCK INC - A | USD | 83.866,00 | 0,22 |
| 532 | BLACKSTONE INC | USD | 61.892,88 | 0,17 |
| 1.100 | BLACKSTONE MORTGAGE TRUST INC - A | USD | 33.352,00 | 0,09 |
| 300 | BOSTON PROPERTIES INC | USD | 32.505,00 | 0,09 |
| 5.800 | BOSTON SCIENTIFIC CORP | USD | 251.662,00 | 0,67 |
| 1.600 | BROADCOM INC | USD | 775.888,00 | 2,08 |
| 2.000 | BROWN & BROWN INC | USD | 110.900,00 | 0,30 |
| 98 | CACI INTERNATIONAL INC - A | USD | 25.685,80 | 0,07 |
| 900 | CARLYLE GROUP INC | USD | 42.552,00 | 0,11 |
| 6.900 | CARRIER GLOBAL CORP | USD | 357.144,00 | 0,96 |
| 2.318 | CBRE GROUP INC - A | USD | 225.680,48 | 0,60 |
| 4.233 | CDK GLOBAL INC | USD | 180.114,15 | 0,48 |
| 1.181 | CDW CORP/DE | USD | 214.965,62 | 0,58 |
| 246 | CH ROBINSON WORLDWIDE INC | USD | 21.402,00 | 0,06 |
| 1.000 | CHEVRON CORP | USD | 101.450,00 | 0,27 |
| 122 | CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC | USD | 221.737,44 | 0,59 |
| 5.000 | CITIGROUP INC | USD | 350.900,00 | 0,94 |
| 1.052 | CITRIX SYSTEMS INC | USD | 112.953,24 | 0,30 |
| 931 | CLOROX CO/THE | USD | 154.182,91 | 0,41 |
| 700 | CME GROUP INC - A | USD | 135.366,00 | 0,36 |
| 7.400 | COCA-COLA CO | USD | 388.278,00 | 1,04 |
| 480 | COGENT COMMUNICATIONS HOLDINGS INC | USD | 34.003,20 | 0,09 |
| 800 | CONOCOPHILLIPS | USD | 54.216,00 | 0,15 |
| 1.000 | CONSTELLATION BRANDS INC - A | USD | 210.690,00 | 0,56 |
| 1.048 | DANAHER CORP | USD | 319.053,12 | 0,86 |
| 500 | DELL TECHNOLOGIES INC - C | USD | 52.020,00 | 0,14 |
| 7.100 | DEVON ENERGY CORP | USD | 252.121,00 | 0,68 |
| 464 | DEXCOM INC | USD | 253.743,04 | 0,68 |
| 600 | DUKE REALTY CORP | USD | 28.722,00 | 0,08 |
| 100 | EAGLE MATERIALS INC | USD | 13.116,00 | 0,04 |
| 100 | ELECTRONIC ARTS INC | USD | 14.225,00 | 0,04 |
| 3.067 | ELI LILLY & CO | USD | 708.630,35 | 1,90 |
| 2.571 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 242.188,20 | 0,65 |
| 300 | ENTERGY CORP | USD | 29.793,00 | 0,08 |
| 301 | EQUIFAX INC | USD | 76.279,42 | 0,20 |
| 100 | ESTEE LAUDER COS INC/THE - A | USD | 29.993,00 | 0,08 |
| 1.547 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 126.482,72 | 0,34 |
| 5.500 | EXXON MOBIL CORP | USD | 323.510,00 | 0,87 |
| 911 | FACEBOOK INC - A | USD | 309.184,29 | 0,83 |
| 4.000 | FASTENAL CO | USD | 206.440,00 | 0,55 |
| 158 | FEDERAL REALTY INVESTMENT TRUST | USD | 18.642,42 | 0,05 |
| 61 | FEDEX CORP | USD | 13.376,69 | 0,04 |
| 2.700 | FIDELITY NATIONAL FINANCIAL INC | USD | 122.418,00 | 0,33 |
| 1.106 | FIVE9 INC | USD | 176.672,44 | 0,47 |
| 3.600 | FOOT LOCKER INC | USD | 164.376,00 | 0,44 |
| 1.200 | FORD MOTOR CO | USD | 16.992,00 | 0,05 |
| 500 | FRONTDOOR INC | USD | 20.950,00 | 0,06 |
| 216 | GAMESTOP CORP | USD | 37.901,52 | 0,10 |
| 3.263 | GENERAL ELECTRIC CO | USD | 336.186,89 | 0,90 |
| 4.200 | HAIN CELESTIAL GROUP INC/THE | USD | 179.676,00 | 0,48 |
| 1.400 | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | USD | 46.872,00 | 0,13 |
| 2.766 | HOME DEPOT INC/THE | USD | 907.967,16 | 2,43 |
| 445 | HONEYWELL INTERNATIONAL INC | USD | 94.464,60 | 0,25 |
| 1.900 | HP INC | USD | 51.984,00 | 0,14 |
| 6.100 | H&R BLOCK INC | USD | 152.500,00 | 0,41 |
| 207 | ILLINOIS TOOL WORKS INC | USD | 42.772,41 | 0,11 |
| 300 | INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | USD | 34.446,00 | 0,09 |
| 300 | IRON MOUNTAIN INC | USD | 13.035,00 | 0,03 |
| 3.100 | JABIL INC | USD | 180.947,00 | 0,49 |
| 1.987 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 325.252,03 | 0,87 |
| 500 | J2 GLOBAL INC | USD | 68.310,00 | 0,18 |
| 5.700 | KINDER MORGAN INC/DE | USD | 95.361,00 | 0,26 |
| 400 | KKR & CO INC | USD | 24.352,00 | 0,07 |
| 822 | LAM RESEARCH CORP | USD | 467.841,30 | 1,25 |
| 353 | LENNOX INTERNATIONAL INC | USD | 103.842,01 | 0,28 |
| 2.100 | LIVENT CORP | USD | 48.531,00 | 0,13 |
| 782 | LOWE'S COS INC | USD | 158.636,52 | 0,43 |
| 8.600 | MACY'S INC | USD | 194.360,00 | 0,52 |
| 1.082 | MADISON SQUARE GARDEN SPORTS CORP | USD | 201.197,90 | 0,54 |
| 3.200 | MARAVAI LIFESCIENCES HOLDINGS INC - A | USD | 157.056,00 | 0,42 |
| 2.426 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 367.369,18 | 0,98 |
| 800 | MASCO CORP | USD | 44.440,00 | 0,12 |
| 1.000 | MASTERCARD INC - A | USD | 347.680,00 | 0,93 |
| 700 | MATCH GROUP INC | USD | 109.893,00 | 0,29 |
| 754 | MCDONALD'S CORP | USD | 181.796,94 | 0,49 |
| 2.400 | MERCK & CO INC | USD | 180.264,00 | 0,48 |
| 206 | METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | USD | 283.736,16 | 0,76 |
| 4.800 | MGIC INVESTMENT CORP | USD | 71.808,00 | 0,19 |
| 9.626 | MICROSOFT CORP | USD | 2.713.761,92 | 7,28 |
| 85 | MIDDLEBY CORP/THE | USD | 14.493,35 | 0,04 |
| 1.479 | MOODY'S CORP | USD | 525.207,69 | 1,41 |
| 3.991 | MORGAN STANLEY | USD | 388.364,21 | 1,04 |
| 6.400 | MULTIPLAN CORP | USD | 36.032,00 | 0,10 |
| 400 | NEW YORK TIMES CO | USD | 19.708,00 | 0,05 |
| 2.580 | NEXTERA ENERGY INC | USD | 202.581,60 | 0,54 |
| 2.172 | NEXTERA ENERGY PARTNERS LP | USD | 163.681,92 | 0,44 |
| 770 | NIKE INC - B | USD | 111.827,10 | 0,30 |
| 1.463 | NVIDIA CORP | USD | 303.075,08 | 0,81 |
| 2.400 | OPTION CARE HEALTH INC | USD | 58.224,00 | 0,16 |
| 3.880 | ORGANON & CO | USD | 127.225,20 | 0,34 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Behavioural Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 1.418 | OWENS CORNING | USD | 121.239,00 | 0,32 |
| 1.184 | PARKER-HANNIFIN CORP | USD | 331.070,08 | 0,89 |
| 1.726 | PELOTON INTERACTIVE INC - A | USD | 150.248,30 | 0,40 |
| 3.000 | PENNYMAC FINANCIAL SERVICES INC | USD | 183.390,00 | 0,49 |
| 5.197 | PEPSICO INC | USD | 781.680,77 | 2,10 |
| 9.500 | PFIZER INC | USD | 408.595,00 | 1,10 |
| 866 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 169.424,24 | 0,45 |
| 2.428 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | USD | 339.434,40 | 0,91 |
| 3.442 | PROGRESSIVE CORP/THE | USD | 311.122,38 | 0,83 |
| 2.200 | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC | USD | 133.980,00 | 0,36 |
| 110 | QORVO INC | USD | 18.390,90 | 0,05 |
| 60 | QUAKER CHEMICAL CORP | USD | 14.263,20 | 0,04 |
| 600 | RADIAN GROUP INC | USD | 13.632,00 | 0,04 |
| 2.300 | REALTY INCOME CORP | USD | 149.178,00 | 0,40 |
| 789 | RINGCENTRAL INC - A | USD | 171.607,50 | 0,46 |
| 100 | ROCKWELL AUTOMATION INC | USD | 29.404,00 | 0,08 |
| 287 | ROSS STORES INC | USD | 31.239,95 | 0,08 |
| 200 | RYDER SYSTEM INC | USD | 16.542,00 | 0,04 |
| 1.000 | SBA COMMUNICATIONS CORP - A | USD | 330.570,00 | 0,89 |
| 300 | SEALED AIR CORP | USD | 16.437,00 | 0,04 |
| 862 | SEMPRA ENERGY | USD | 109.043,00 | 0,29 |
| 345 | SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | USD | 96.506,85 | 0,26 |
| 4.400 | SIRIUS XM HOLDINGS INC | USD | 26.840,00 | 0,07 |
| 1.571 | S&P GLOBAL INC | USD | 667.502,19 | 1,79 |
| 479 | SQUARE INC - A | USD | 114.883,36 | 0,31 |
| 192 | STANLEY BLACK & DECKER INC | USD | 33.659,52 | 0,09 |
| 7.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC | USD | 170.870,00 | 0,46 |
| 300 | STEEL DYNAMICS INC | USD | 17.544,00 | 0,05 |
| 500 | SYSCO CORP | USD | 39.250,00 | 0,11 |
| 800 | TARGA RESOURCES CORP | USD | 39.368,00 | 0,11 |
| 800 | TEMPUR SEALY INTERNATIONAL INC | USD | 37.128,00 | 0,10 |
| 1.815 | TERADYNE INC | USD | 198.143,55 | 0,53 |
| 73 | TESLA INC | USD | 56.610,04 | 0,15 |
| 1.505 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 289.276,05 | 0,78 |
| 738 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 421.641,54 | 1,13 |
| 304 | T-MOBILE US INC | USD | 38.839,04 | 0,10 |
| 2.322 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 907.298,28 | 2,43 |
| 500 | VALVOLINE INC | USD | 15.590,00 | 0,04 |
| 353 | VERISIGN INC | USD | 72.368,53 | 0,19 |
| 239 | VERISK ANALYTICS INC - A | USD | 47.864,53 | 0,13 |
| 5.800 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 313.258,00 | 0,84 |
| 4.027 | VISA INC - A | USD | 897.014,25 | 2,40 |
| 200 | VULCAN MATERIALS CO | USD | 33.832,00 | 0,09 |
| 2.019 | WALMART INC | USD | 281.408,22 | 0,75 |
| 2.582 | WALT DISNEY CO/THE | USD | 436.796,94 | 1,17 |
| 100 | WD-40 CO | USD | 23.148,00 | 0,06 |
| 8.968 | WESTERN UNION CO/THE | USD | 181.332,96 | 0,49 |
| 500 | WILLIAMS-SONOMA INC | USD | 88.665,00 | 0,24 |
| 7.400 | ZYNGA INC - A | USD | 55.722,00 | 0,15 |
| 3.300 | 3M CO | USD | 578.886,00 | 1,55 |
| | | | **36.426.907,07** | **97,65** |
| | **Irland** | | | |
| 300 | ALLEGION PLC | USD | 39.654,00 | 0,11 |
| 230 | AON PLC - A | USD | 65.727,10 | 0,18 |
| 285 | ICON PLC - ADR | USD | 74.675,70 | 0,20 |
| 762 | LINDE PLC | USD | 223.555,56 | 0,59 |
| | | | **403.612,36** | **1,08** |
| | **Bermuda** | | | |
| 800 | ATHENE HOLDING LTD - A | USD | 55.096,00 | 0,15 |
| 8.000 | INVESCO LTD | USD | 192.880,00 | 0,51 |
| | | | **247.976,00** | **0,66** |
| | **Jersey** | | | |
| 1.700 | CLARIVATE PLC | USD | 37.230,00 | 0,10 |
| | | | **37.230,00** | **0,10** |
| | **Curacao** | | | |
| 900 | SCHLUMBERGER NV | USD | 26.676,00 | 0,07 |
| | | | **26.676,00** | **0,07** |
| | | | **37.142.401,43** | **99,56** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **37.142.401,43** | **99,56** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **37.142.401,43** | **99,56** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **0,00** | **0,00** |
| **Bankguthaben** | **140.481,40** | **0,38** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **24.643,13** | **0,06** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **37.307.525,96** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 3.016.046.924,61 |
| | 30.09.2020 | USD | 4.915.913.248,42 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.918.022.099,14 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.281,58 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.042,32 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.881,17 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 11.341,12 |
| | 30.09.2020 | USD | 11.037,88 |
| | 30.09.2019 | USD | 9.988,25 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 7.114,21 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.992,86 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.482,94 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 30,34 |
| | 30.09.2020 | EUR | 29,82 |
| | 30.09.2019 | EUR | 27,68 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.703,72 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.665,78 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.514,40 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 295,34 |
| | 30.09.2020 | EUR | 291,46 |
| | 30.09.2019 | EUR | 271,53 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 315,27 |
| | 30.09.2020 | USD | 307,06 |
| | 30.09.2019 | USD | 278,08 |
| Capitalisation R Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | CHF | 287,57 |
| | 30.09.2020 | CHF | 283,69 |
| | 30.09.2019 | CHF | 263,86 |
| Capitalisation R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 252,26 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | GBP | 123,12 |
| | 30.09.2020 | GBP | 120,29 |
| | 30.09.2019 | GBP | 110,96 |
| Capitalisation R Hedged (i) (SEK) | 30.09.2021 | SEK | 2.491,28 |
| | 30.09.2020 | SEK | - |
| | 30.09.2019 | SEK | - |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.619,29 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.587,13 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.446,40 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 364,68 |
| | 30.09.2020 | USD | 361,05 |
| | 30.09.2019 | USD | 332,36 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.903,25 |
| | 30.09.2020 | USD | 6.694,26 |
| | 30.09.2019 | USD | 6.035,89 |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 6.063,82 |
| | 30.09.2020 | EUR | 5.934,39 |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.480,56 |
| Distribution I (Q) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 5.956,97 |
| Distribution I (Q) (USD) | 30.09.2021 | USD | 5.955,95 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.913,74 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.510,45 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 250,20 |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | - |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 3.752,39 |
| | 30.09.2020 | USD | 3.743,19 |
| | 30.09.2019 | USD | 3.486,23 |
| Distribution P (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 246,12 |
| | 30.09.2020 | USD | - |
| | 30.09.2019 | USD | - |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 3.761,04 |
| | 30.09.2020 | USD | 3.751,64 |
| | 30.09.2019 | USD | 3.494,29 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 122,75 |
| | 30.09.2020 | USD | 124,58 |
| | 30.09.2019 | USD | 117,69 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 269,23 |
| | 30.09.2020 | AUD | 274,43 |
| | 30.09.2019 | AUD | 263,88 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 4.181,73 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 4.236,28 |
| | 30.09.2019 | ZAR | - |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 254,46 |
| | 30.09.2020 | USD | 261,20 |
| | 30.09.2019 | USD | 249,49 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 291,74 |
| | 30.09.2020 | AUD | 300,81 |
| | 30.09.2019 | AUD | 292,33 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 4.107,37 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 4.200,03 |
| | 30.09.2019 | ZAR | - |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 5.228 |
| | 30.09.2020 | 2.217 |
| | 30.09.2019 | 2.348 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 58.555 |
| | 30.09.2020 | 153.128 |
| | 30.09.2019 | 45.469 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 143.565 |
| | 30.09.2020 | 165.580 |
| | 30.09.2019 | 62.529 |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 852.374 |
| | 30.09.2020 | 1.195.563 |
| | 30.09.2019 | 1.785.829 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 85.145 |
| | 30.09.2020 | 130.042 |
| | 30.09.2019 | 54.408 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 117.735 |
| | 30.09.2020 | 229.751 |
| | 30.09.2019 | 53.206 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 128.112 |
| | 30.09.2020 | 84.006 |
| | 30.09.2019 | 26.702 |
| Capitalisation R Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 62.582 |
| | 30.09.2020 | 67.248 |
| | 30.09.2019 | 65.133 |
| Capitalisation R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1.397 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 8 |
| | 30.09.2020 | 2.043 |
| | 30.09.2019 | 1.983 |
| Capitalisation R Hedged (i) (SEK) | 30.09.2021 | 2.061 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 60.860 |
| | 30.09.2020 | 108.035 |
| | 30.09.2019 | 57.399 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 140.638 |
| | 30.09.2020 | 188.506 |
| | 30.09.2019 | 55.896 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | 8.147 |
| | 30.09.2020 | 72.424 |
| | 30.09.2019 | 56.150 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 17.460 |
| | 30.09.2020 | 11.681 |
| | 30.09.2019 | 12.346 |
| Distribution I (Q) (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | 14.851 |
| Distribution I (Q) (USD) | 30.09.2021 | 15.307 |
| | 30.09.2020 | 11.444 |
| | 30.09.2019 | 3.958 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 100 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 14.780 |
| | 30.09.2020 | 18.952 |
| | 30.09.2019 | 12.042 |
| Distribution P (M) (USD) | 30.09.2021 | 400 |
| | 30.09.2020 | - |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 6.998 |
| | 30.09.2020 | 11.147 |
| | 30.09.2019 | 207 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 1.000.111 |
| | 30.09.2020 | 1.348.557 |
| | 30.09.2019 | 645.444 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 80.280 |
| | 30.09.2020 | 106.651 |
| | 30.09.2019 | 74.231 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 13.311 |
| | 30.09.2020 | 22.095 |
| | 30.09.2019 | - |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 667.351 |
| | 30.09.2020 | 892.734 |
| | 30.09.2019 | 226.841 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 117.999 |
| | 30.09.2020 | 158.381 |
| | 30.09.2019 | 45.144 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 57.143 |
| | 30.09.2020 | 80.973 |
| | 30.09.2019 | - |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Dividende**

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (Q) (USD) | 11.08.2021 | USD | 25,50 |
| Distribution I (Q) (USD) | 12.05.2021 | USD | 27,50 |
| Distribution I (Q) (USD) | 11.02.2021 | USD | 31,80 |
| Distribution I (Q) (USD) | 11.11.2020 | USD | 33,85 |
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 76,25 |
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 91,15 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,36 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,81 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 0,81 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 26,50 |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 07.04.2021 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.10.2020 | USD | 0,78 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,92 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 07.04.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.10.2020 | AUD | 0,92 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 07.04.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 26,50 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.10.2020 | ZAR | 26,50 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,51% |
| Capitalisation N Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,57% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,97% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Capitalisation R Hedged (i) (CHF) | 30.09.2021 | 0,58% |
| Capitalisation R Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,58% |
| Capitalisation R Hedged (i) (GBP) | 30.09.2021 | 0,58% |
| Capitalisation R Hedged (i) (SEK) | 30.09.2021 | 0,58% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 1,20% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 2,20% |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | 0,13% |
| Capitalisation Z Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,15% |
| Distribution I (Q) (USD) | 30.09.2021 | 0,49% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Distribution P (M) (USD) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 0,56% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 1,20% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 1,22% |
| Distribution X Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 1,22% |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,20% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 2,22% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 2,22% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 543,49% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **2.975.168.374,20** |
| Aktien | | 6.839.811,30 |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 2.968.328.562,90 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **3.304.402,93** |
| Futures | | 3.304.402,93 |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **2.341.025,92** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **219.247.492,49** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***3.200.061.295,54*** |
| **Bankverbindlichkeiten** | | **(1.074.076,36)** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(148.402.511,16)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(34.537.783,41)** |
| Devisentermingeschäfte | | (34.537.783,41) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(184.014.370,93)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***3.016.046.924,61*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **96.624.662,56** |
| Dividenden | | 228.642,78 |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 95.367.987,33 |
| Bankzinsen | | 14.148,26 |
| Sonstige Erträge | 10 | 1.013.884,19 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(26.546.278,49)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (17.587.684,69) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (7.906.393,48) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (306.441,95) |
| Abonnementsteuer | 9 | (745.758,37) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **70.078.384,07** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 189.206.597,29 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (86.648.398,31) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 41.231.326,33 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (41.328.875,73) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 3.285.196,00 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (4.755.594,95) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (105.690.549,19) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 2.427.007,41 |
| **Ergebnis** | | **67.805.092,92** |
| Zeichnungen | | 2.089.229.467,29 |
| Rücknahmen | | (4.036.382.914,07) |
| Ausschüttung | | (20.517.969,95) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 4.915.913.248,42 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***3.016.046.924,61*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 258.594 | SOUTHERN CO/THE | USD | 6.839.811,30 | 0,23 |
| | | | **6.839.811,30** | **0,23** |
| | | | **6.839.811,30** | **0,23** |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 1.681.000 | ABBVIE INC 2.950% 21/11/2026 | USD | 1.801.198,02 | 0,06 |
| 6.113.000 | ABBVIE INC 3.200% 14/05/2026 | USD | 6.589.303,14 | 0,22 |
| 6.336.000 | ABBVIE INC 3.200% 21/11/2029 | USD | 6.827.434,35 | 0,23 |
| 6.681.000 | ABBVIE INC 4.050% 21/11/2039 | USD | 7.674.522,96 | 0,25 |
| 2.219.000 | ABBVIE INC 4.250% 21/11/2049 | USD | 2.627.255,59 | 0,09 |
| 4.901.000 | ABBVIE INC 4.500% 14/05/2035 | USD | 5.858.408,00 | 0,19 |
| 4.637.000 | ABBVIE INC 4.625% 01/10/2042 | USD | 5.597.881,50 | 0,19 |
| 1.630.000 | AEP TRANSMISSION CO LLC 2.750% 15/08/2051 | USD | 1.563.788,76 | 0,05 |
| 2.971.000 | AES CORP/THE 1.375% 15/01/2026 | USD | 2.920.285,18 | 0,10 |
| 2.176.000 | ALABAMA POWER CO 2.800% 01/04/2025 | USD | 2.292.687,28 | 0,08 |
| 2.540.000 | ALABAMA POWER CO 3.125% 15/07/2051 | USD | 2.603.727,51 | 0,09 |
| 1.689.000 | ALABAMA POWER CO 3.450% 01/10/2049 | USD | 1.832.076,68 | 0,06 |
| 370.000 | ALABAMA POWER CO 3.850% 01/12/2042 | USD | 421.578,61 | 0,01 |
| 2.041.000 | ALABAMA POWER CO 5.200% 01/06/2041 | USD | 2.635.170,86 | 0,09 |
| 4.067.073 | ALASKA AIRLINES 2020-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.800% 15/08/2027 | USD | 4.526.057,81 | 0,15 |
| 5.773.000 | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC 1.875% 01/02/2033 | USD | 5.444.439,92 | 0,18 |
| 2.634.000 | AMAZON.COM INC 2.100% 12/05/2031 | USD | 2.667.930,69 | 0,09 |
| 8.155.000 | AMAZON.COM INC 3.100% 12/05/2051 | USD | 8.582.638,33 | 0,28 |
| 4.537.000 | AMAZON.COM INC 3.250% 12/05/2061 | USD | 4.817.822,47 | 0,16 |
| 3.538.000 | AMCOR FLEXIBLES NORTH AMERICA INC 2.690% 25/05/2031 | USD | 3.623.575,94 | 0,12 |
| 803.000 | AMERICAN AIRLINES INC/AADVANTAGE LOYALTY IP LTD 5.500% 20/04/2026 | USD | 843.895,51 | 0,03 |
| 803.000 | AMERICAN AIRLINES INC/AADVANTAGE LOYALTY IP LTD 5.750% 20/04/2029 | USD | 865.400,01 | 0,03 |
| 1.478.964 | AMERICAN AIRLINES 2015-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.000% 22/09/2027 | USD | 1.438.583,51 | 0,05 |
| 3.086.145 | AMERICAN AIRLINES 2016-3 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 3.000% 15/10/2028 | USD | 3.108.721,10 | 0,10 |
| 2.071.094 | AMERICAN AIRLINES 2017-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.000% 15/02/2029 | USD | 2.074.440,16 | 0,07 |
| 3.214.844 | AMERICAN AIRLINES 2017-1 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 3.650% 15/02/2029 | USD | 3.350.637,62 | 0,11 |
| 2.447.000 | AMERICAN ELECTRIC POWER CO INC 0.750% 01/11/2023 | USD | 2.447.126,04 | 0,08 |
| 21.958.000 | AMERICAN HOMES 4 RENT LP 4.250% 15/02/2028 | USD | 24.820.773,15 | 0,81 |
| 4.142.000 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.400% 30/06/2030 | USD | 4.523.952,21 | 0,15 |
| 13.691.000 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 3.900% 01/04/2026 | USD | 15.169.329,95 | 0,50 |
| 2.601.000 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 4.200% 01/04/2028 | USD | 2.963.770,50 | 0,10 |
| 3.942.000 | AMERICAN INTERNATIONAL GROUP INC 6.250% 01/05/2036 | USD | 5.492.591,77 | 0,18 |
| 2.770.000 | AMERICAN TOWER CORP 3.600% 15/01/2028 | USD | 3.017.313,61 | 0,10 |
| 855.000 | AMERICAN TOWER CORP 4.400% 15/02/2026 | USD | 955.287,08 | 0,03 |
| 1.990.000 | AMERICAN TRANSMISSION SYSTEMS INC 5.000% 01/09/2044 | USD | 2.548.705,10 | 0,08 |
| 3.891.000 | AMGEN INC 2.200% 21/02/2027 | USD | 4.023.431,20 | 0,13 |
| 1.724.000 | AMGEN INC 2.300% 25/02/2031 | USD | 1.728.242,21 | 0,06 |
| 2.542.000 | AMGEN INC 2.450% 21/02/2030 | USD | 2.597.745,27 | 0,09 |
| 5.744.000 | AMGEN INC 3.150% 21/02/2040 | USD | 5.855.217,11 | 0,19 |
| 3.795.000 | AMPHENOL CORP 2.200% 15/09/2031 | USD | 3.764.233,44 | 0,12 |
| 3.266.000 | ANALOG DEVICES INC 2.800% 01/10/2041 | USD | 3.266.783,02 | 0,11 |
| 4.365.000 | ANALOG DEVICES INC 2.950% 01/10/2051 | USD | 4.362.387,68 | 0,14 |
| 11.170.000 | ANHEUSER-BUSCH COS LLC / ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 3.650% 01/02/2026 | USD | 12.256.931,81 | 0,41 |
| 12.737.000 | ANHEUSER-BUSCH COS LLC / ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.900% 01/02/2046 | USD | 15.817.757,03 | 0,52 |
| 4.744.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.375% 15/04/2038 | USD | 5.538.251,44 | 0,18 |
| 5.119.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.439% 06/10/2048 | USD | 6.007.350,85 | 0,20 |
| 3.158.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 4.750% 23/01/2029 | USD | 3.718.604,50 | 0,12 |
| 1.943.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 5.550% 23/01/2049 | USD | 2.630.611,28 | 0,09 |
| 3.195.000 | ANTHEM INC 2.875% 15/09/2029 | USD | 3.364.210,11 | 0,11 |
| 1.211.000 | ANTHEM INC 4.550% 01/03/2048 | USD | 1.490.290,36 | 0,05 |
| 2.530.000 | ANTHEM INC 4.625% 15/05/2042 | USD | 3.100.874,23 | 0,10 |
| 2.443.000 | ANTHEM INC 5.100% 15/01/2044 | USD | 3.162.989,28 | 0,10 |
| 2.434.000 | APPALACHIAN POWER CO 2.700% 01/04/2031 | USD | 2.501.046,53 | 0,08 |
| 2.272.000 | APPALACHIAN POWER CO 3.400% 01/06/2025 | USD | 2.435.181,08 | 0,08 |
| 948.000 | APPALACHIAN POWER CO 3.700% 01/05/2050 | USD | 1.031.768,93 | 0,03 |
| 1.132.000 | APPALACHIAN POWER CO 4.500% 01/03/2049 | USD | 1.384.587,08 | 0,05 |
| 36.810.000 | APPLE INC 1.200% 08/02/2028 | USD | 36.055.208,37 | 1,19 |
| 1.660.000 | APPLE INC 1.700% 05/08/2031 | USD | 1.618.300,07 | 0,05 |
| 4.697.000 | APPLE INC 2.700% 05/08/2051 | USD | 4.567.333,40 | 0,15 |
| 11.765.000 | APPLE INC 2.850% 05/08/2061 | USD | 11.374.875,07 | 0,38 |
| 3.719.000 | APPLE INC 3.850% 04/05/2043 | USD | 4.342.256,65 | 0,14 |
| 8.443.000 | APPLE INC 4.250% 09/02/2047 | USD | 10.451.949,46 | 0,35 |
| 1.183.000 | APPLE INC 4.375% 13/05/2045 | USD | 1.490.862,61 | 0,05 |
| 1.500.000 | APPLE INC 4.500% 23/02/2036 | USD | 1.877.792,19 | 0,06 |
| 923.000 | APPLE INC 4.650% 23/02/2046 | USD | 1.201.065,82 | 0,04 |
| 2.031.000 | ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO 2.700% 15/09/2051 | USD | 1.988.943,03 | 0,07 |
| 2.636.000 | ARTHUR J GALLAGHER & CO 3.500% 20/05/2051 | USD | 2.802.868,87 | 0,09 |
| 8.009.000 | ASSURANT INC 2.650% 15/01/2032 | USD | 7.941.850,86 | 0,26 |
| 2.173.000 | ASSURANT INC 3.700% 22/02/2030 | USD | 2.364.657,04 | 0,08 |
| 6.834.000 | AT&T INC 1.700% 25/03/2026 | USD | 6.922.527,43 | 0,23 |
| 6.198.000 | AT&T INC 3.500% 01/06/2041 | USD | 6.365.684,41 | 0,21 |
| 13.098.000 | AT&T INC 3.550% 15/09/2055 | USD | 12.913.805,05 | 0,43 |
| 11.082.000 | AT&T INC 3.650% 15/09/2059 | USD | 10.969.126,95 | 0,36 |
| 4.371.000 | AT&T INC 3.8% 12/01/57 | USD | 4.467.272,76 | 0,15 |
| 2.180.000 | AVALONBAY COMMUNITIES INC 3.300% 01/06/2029 | USD | 2.377.240,60 | 0,08 |
| 2.746.000 | AVIATION CAPITAL GROUP LLC 1.950% 20/09/2026 | USD | 2.721.067,80 | 0,09 |
| 3.157.000 | AVIATION CAPITAL GROUP LLC 3.875% 01/05/2023 | USD | 3.293.611,19 | 0,11 |
| 2.382.000 | AVIATION CAPITAL GROUP LLC 4.375% 30/01/2024 | USD | 2.543.263,69 | 0,08 |
| 5.364.000 | BANK OF AMERICA CORP 11/03/2027 FRN | USD | 5.391.260,38 | 0,18 |
| 9.692.000 | BANK OF AMERICA CORP 13/02/2026 FRN | USD | 9.944.778,41 | 0,33 |
| 5.500.000 | BANK OF AMERICA CORP 19/06/2026 FRN | USD | 5.498.271,52 | 0,18 |
| 834.000 | BANK OF AMERICA CORP 19/06/2041 FRN | USD | 806.245,76 | 0,03 |
| 2.790.000 | BANK OF AMERICA CORP 20/03/2051 FRN | USD | 3.300.879,27 | 0,11 |
| 2.680.000 | BANK OF AMERICA CORP 20/12/2028 FRN | USD | 2.906.957,03 | 0,10 |
| 9.277.000 | BANK OF AMERICA CORP 21/07/2032 FRN | USD | 9.145.407,80 | 0,30 |
| 3.078.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/04/2025 FRN | USD | 3.093.834,68 | 0,10 |
| 9.874.000 | BANK OF AMERICA CORP 22/04/2032 FRN | USD | 10.079.657,05 | 0,33 |
| 4.097.000 | BANK OF AMERICA CORP 23/04/2040 FRN | USD | 4.712.558,11 | 0,16 |
| 5.957.000 | BANK OF AMERICA CORP 23/07/2029 FRN | USD | 6.754.712,71 | 0,22 |
| 4.195.000 | BANK OF AMERICA CORP 23/07/2030 FRN | USD | 4.470.319,86 | 0,15 |
| 15.240.000 | BANK OF AMERICA CORP 23/07/2031 FRN | USD | 14.668.121,13 | 0,49 |
| 3.052.000 | BANK OF AMERICA CORP 25/09/2025 FRN | USD | 3.055.675,34 | 0,10 |
| 1.324.000 | BANK OF AMERICA CORP 29/04/2031 FRN | USD | 1.350.531,42 | 0,04 |
| 4.778.000 | BANK OF AMERICA CORP 4.250% 22/10/2026 | USD | 5.380.628,55 | 0,18 |
| 4.481.000 | BANK OF AMERICA CORP 6.110% 29/01/2037 | USD | 6.042.207,82 | 0,20 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 7.440.000 | BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO LLC 2.000% 30/01/2032 | USD | 7.161.675,85 | 0,24 |
| 5.033.000 | BLACKSTONE HOLDINGS FINANCE CO LLC 2.850% 05/08/2051 | USD | 4.835.195,95 | 0,16 |
| 3.330.000 | BLACKSTONE SECURED LENDING FUND 2.850% 30/09/2028 | USD | 3.322.235,17 | 0,11 |
| 5.720.000 | BLUE OWL FINANCE LLC 3.125% 10/06/2031 | USD | 5.669.608,23 | 0,19 |
| 5.828.000 | BOEING CO/THE 3.250% 01/02/2028 | USD | 6.160.162,84 | 0,20 |
| 8.984.000 | BOEING CO/THE 4.508% 01/05/2023 | USD | 9.489.391,15 | 0,31 |
| 4.557.000 | BOEING CO/THE 4.875% 01/05/2025 | USD | 5.073.444,35 | 0,17 |
| 6.103.000 | BOEING CO/THE 5.705% 01/05/2040 | USD | 7.765.667,02 | 0,26 |
| 2.419.000 | BOEING CO/THE 5.805% 01/05/2050 | USD | 3.233.372,73 | 0,11 |
| 927.000 | BOEING CO/THE 5.930% 01/05/2060 | USD | 1.266.479,84 | 0,04 |
| 4.143.000 | BOSTON SCIENTIFIC CORP 4.700% 01/03/2049 | USD | 5.280.769,55 | 0,18 |
| 1.120.000 | BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.000% 24/02/2050 | USD | 1.078.472,21 | 0,04 |
| 6.152.000 | BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.379% 08/02/2061 | USD | 6.120.628,49 | 0,20 |
| 5.201.000 | BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.410% 11/02/2026 | USD | 5.669.732,64 | 0,19 |
| 6.894.000 | BP CAPITAL MARKETS AMERICA INC 3.937% 21/09/2028 | USD | 7.770.262,01 | 0,26 |
| 2.663.000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 1.125% 13/11/2027 | USD | 2.623.678,81 | 0,09 |
| 2.291.000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 2.550% 13/11/2050 | USD | 2.159.919,70 | 0,07 |
| 4.516.000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.200% 15/06/2026 | USD | 4.923.749,46 | 0,16 |
| 1.482.000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 3.875% 15/08/2025 | USD | 1.633.590,42 | 0,05 |
| 1.993.000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.250% 26/10/2049 | USD | 2.472.869,46 | 0,08 |
| 3.365.000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 4.550% 20/02/2048 | USD | 4.317.288,88 | 0,14 |
| 707.000 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO 5.000% 15/08/2045 | USD | 950.147,82 | 0,03 |
| 2.541.000 | BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.375% 01/09/2042 | USD | 3.117.156,22 | 0,10 |
| 1.530.000 | BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.400% 15/03/2042 | USD | 1.870.891,41 | 0,06 |
| 2.175.000 | BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 4.900% 01/04/2044 | USD | 2.849.160,65 | 0,09 |
| 2.162.000 | BURLINGTON NORTHERN SANTA FE LLC 5.150% 01/09/2043 | USD | 2.914.349,26 | 0,10 |
| 4.462.000 | CAMERON LNG LLC 2.902% 15/07/2031 | USD | 4.731.021,74 | 0,16 |
| 12.539.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.250% 01/02/2031 | USD | 12.754.221,90 | 0,42 |
| 11.147.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 01/05/2032 | USD | 11.480.208,02 | 0,38 |
| 6.260.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 01/06/2033 | USD | 6.376.922,15 | 0,21 |
| 5.547.000 | CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028 | USD | 5.573.811,81 | 0,18 |
| 2.940.000 | CENTENE CORP 2.625% 01/08/2031 | USD | 2.921.816,25 | 0,10 |
| 565.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 3.500% 01/03/2042 | USD | 551.593,66 | 0,02 |
| 2.943.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 3.850% 01/04/2061 | USD | 2.805.193,41 | 0,09 |
| 5.035.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 3.950% 30/06/2062 | USD | 4.868.912,42 | 0,16 |
| 1.932.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 5.125% 01/07/2049 | USD | 2.268.123,08 | 0,08 |
| 876.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 6.484% 23/10/2045 | USD | 1.189.025,85 | 0,04 |
| 6.765.000 | CHENIERE CORPUS CHRISTI HOLDINGS LLC 3.700% 15/11/2029 | USD | 7.356.982,76 | 0,24 |
| 809.000 | CHEVRON USA INC 3.250% 15/10/2029 | USD | 885.536,94 | 0,03 |
| 5.404.000 | CHEVRON USA INC 4.200% 15/10/2049 | USD | 6.573.213,01 | 0,22 |
| 4.689.000 | CIGNA CORP 3.200% 15/03/2040 | USD | 4.806.422,74 | 0,16 |
| 6.935.000 | CIGNA CORP 4.800% 15/08/2038 | USD | 8.487.338,17 | 0,28 |
| 2.186.000 | CIGNA CORP 4.900% 15/12/2048 | USD | 2.790.049,05 | 0,09 |
| 10.683.000 | CIMAREX ENERGY CO 3.900% 15/05/2027 | USD | 11.695.781,94 | 0,39 |
| 2.369.000 | CIMAREX ENERGY CO 4.375% 15/03/2029 | USD | 2.672.036,46 | 0,09 |
| 3.197.000 | CITIGROUP INC 08/04/2026 FRN | USD | 3.394.347,04 | 0,11 |
| 3.116.000 | CITIGROUP INC 15/05/2024 FRN | USD | 3.177.055,96 | 0,11 |
| 3.141.000 | CITIGROUP INC 30/10/2024 FRN | USD | 3.152.377,11 | 0,10 |
| 1.719.000 | CITIGROUP INC 31/03/2031 FRN | USD | 1.984.207,04 | 0,07 |
| 8.446.000 | CITIGROUP INC 4.450% 29/09/2027 | USD | 9.605.682,17 | 0,32 |
| 12.152.000 | CMS ENERGY CORP 01/06/2050 FRN | USD | 13.652.367,82 | 0,45 |
| 10.586.000 | COMCAST CORP 2.887% 01/11/2051 | USD | 10.150.546,80 | 0,34 |
| 1.030.000 | COMCAST CORP 3.200% 15/07/2036 | USD | 1.096.532,11 | 0,04 |
| 5.171.000 | COMCAST CORP 3.250% 01/11/2039 | USD | 5.468.231,15 | 0,18 |
| 2.552.000 | COMCAST CORP 3.900% 01/03/2038 | USD | 2.906.160,92 | 0,10 |
| 2.801.000 | COMCAST CORP 4.000% 15/08/2047 | USD | 3.209.416,78 | 0,11 |
| 4.252.000 | COMCAST CORP 5.650% 15/06/2035 | USD | 5.688.600,49 | 0,19 |
| 1.046.000 | COMCAST CORP 6.500% 15/11/2035 | USD | 1.501.791,71 | 0,05 |
| 2.846.000 | COMMONWEALTH EDISON CO 3.800% 01/10/2042 | USD | 3.224.677,40 | 0,11 |
| 7.297.000 | CONOCOPHILLIPS 2.400% 15/02/2031 | USD | 7.412.910,36 | 0,25 |
| 2.264.000 | CONSOLIDATED EDISON CO OF NEW YORK INC 4.625% 01/12/2054 | USD | 2.800.956,03 | 0,09 |
| 5.749.436 | CONTINENTAL AIRLINES 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.000% 29/10/2024 | USD | 6.027.132,98 | 0,20 |
| 5.516.000 | CORNING INC 5.450% 15/11/2079 | USD | 7.470.992,03 | 0,25 |
| 5.913.000 | CSX CORP 4.650% 01/03/2068 | USD | 7.632.662,00 | 0,25 |
| 4.174.000 | CVS HEALTH CORP 1.300% 21/08/2027 | USD | 4.108.343,69 | 0,14 |
| 3.894.000 | CVS HEALTH CORP 2.125% 15/09/2031 | USD | 3.824.119,02 | 0,13 |
| 3.212.000 | CVS HEALTH CORP 2.700% 21/08/2040 | USD | 3.076.771,97 | 0,10 |
| 10.177.000 | CVS HEALTH CORP 4.780% 25/03/2038 | USD | 12.456.862,02 | 0,41 |
| 4.688.000 | CVS HEALTH CORP 5.050% 25/03/2048 | USD | 6.045.667,11 | 0,20 |
| 546.211 | DELTA AIR LINES 2015-1 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 3.625% 30/07/2027 | USD | 588.032,53 | 0,02 |
| 6.874.238 | DELTA AIR LINES 2015-1 CLASS B PASS THROUGH TRUST 4.250% 30/07/2023 | USD | 7.028.898,67 | 0,23 |
| 2.856.273 | DELTA AIR LINES 2020-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 2.500% 10/06/2028 | USD | 2.877.597,70 | 0,10 |
| 3.267.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 3.125% 24/03/2031 | USD | 3.387.507,38 | 0,11 |
| 2.281.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 3.250% 01/12/2026 | USD | 2.438.146,87 | 0,08 |
| 7.065.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 3.500% 01/12/2029 | USD | 7.558.001,21 | 0,25 |
| 3.380.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 4.400% 24/03/2051 | USD | 3.832.559,96 | 0,13 |
| 798.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 4.750% 31/05/2025 | USD | 890.543,82 | 0,03 |
| 1.349.000 | DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 3.450% 15/03/2025 | USD | 1.440.936,12 | 0,05 |
| 3.700.000 | DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 4.875% 01/04/2043 | USD | 4.401.147,60 | 0,15 |
| 4.214.000 | DISCOVERY COMMUNICATIONS LLC 5.300% 15/05/2049 | USD | 5.258.130,72 | 0,17 |
| 3.772.000 | DOW CHEMICAL CO/THE 2.100% 15/11/2030 | USD | 3.736.358,90 | 0,12 |
| 1.847.000 | DOW CHEMICAL CO/THE 4.375% 15/11/2042 | USD | 2.177.979,87 | 0,07 |
| 3.264.000 | DOW CHEMICAL CO/THE 5.550% 30/11/2048 | USD | 4.479.765,12 | 0,15 |
| 1.209.000 | DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 3.875% 15/03/2046 | USD | 1.380.481,31 | 0,05 |
| 3.740.000 | DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 4.000% 30/09/2042 | USD | 4.280.197,19 | 0,14 |
| 2.767.000 | DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 4.250% 15/12/2041 | USD | 3.292.883,15 | 0,11 |
| 1.912.000 | DUKE ENERGY CAROLINAS LLC 6.450% 15/10/2032 | USD | 2.603.076,42 | 0,09 |
| 8.580.000 | DUKE ENERGY CORP 2.550% 15/06/2031 | USD | 8.714.804,50 | 0,29 |
| 812.000 | DUKE ENERGY CORP 3.150% 15/08/2027 | USD | 875.405,00 | 0,03 |
| 1.713.000 | DUKE ENERGY INDIANA LLC 3.750% 15/05/2046 | USD | 1.899.378,65 | 0,06 |
| 2.492.000 | DUKE ENERGY OHIO INC 3.700% 15/06/2046 | USD | 2.793.606,09 | 0,09 |
| 2.662.000 | DUKE ENERGY OHIO INC 4.300% 01/02/2049 | USD | 3.257.951,28 | 0,11 |
| 5.319.000 | DUKE ENERGY PROGRESS LLC 4.100% 15/03/2043 | USD | 6.233.315,20 | 0,21 |
| 3.817.000 | DUKE ENERGY PROGRESS LLC 4.100% 15/05/2042 | USD | 4.438.778,54 | 0,15 |
| 3.550.000 | DUKE ENERGY PROGRESS LLC 4.150% 01/12/2044 | USD | 4.200.917,53 | 0,14 |
| 2.585.000 | DUKE ENERGY PROGRESS LLC 4.200% 15/08/2045 | USD | 3.068.294,62 | 0,10 |
| 2.780.000 | DXC TECHNOLOGY CO 1.800% 15/09/2026 | USD | 2.776.195,46 | 0,09 |
| 2.780.000 | DXC TECHNOLOGY CO 2.375% 15/09/2028 | USD | 2.753.363,43 | 0,09 |
| 8.533.000 | EMPOWER FINANCE 2020 LP 1.357% 17/09/2027 | USD | 8.378.620,45 | 0,28 |
| 456.000 | ENTERGY ARKANSAS LLC 2.650% 15/06/2051 | USD | 424.800,03 | 0,01 |
| 4.826.000 | ENTERGY ARKANSAS LLC 3.350% 15/06/2052 | USD | 5.104.786,73 | 0,17 |
| 3.023.000 | ENTERGY ARKANSAS LLC 4.200% 01/04/2049 | USD | 3.652.968,59 | 0,12 |
| 1.504.000 | ENTERGY GULF STATES LOUISIANA LLC 5.590% 01/10/2024 | USD | 1.708.082,57 | 0,06 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 696.000 | ENTERGY LOUISIANA LLC 0.620% 17/11/2023 | USD | 696.066,29 | 0,02 |
| 425.000 | ENTERGY LOUISIANA LLC 3.250% 01/04/2028 | USD | 459.315,25 | 0,02 |
| 1.618.000 | ENTERGY LOUISIANA LLC 4.000% 15/03/2033 | USD | 1.860.041,46 | 0,06 |
| 402.000 | ENTERGY LOUISIANA LLC 4.050% 01/09/2023 | USD | 425.345,52 | 0,01 |
| 2.200.000 | ENTERGY LOUISIANA LLC 4.200% 01/09/2048 | USD | 2.639.146,40 | 0,09 |
| 12.645.000 | ENTERGY LOUISIANA LLC 4.950% 15/01/2045 | USD | 13.818.526,05 | 0,46 |
| 2.508.000 | ENTERGY LOUISIANA LLC 5.400% 01/11/2024 | USD | 2.848.711,90 | 0,09 |
| 892.000 | ENTERGY MISSISSIPPI LLC 3.500% 01/06/2051 | USD | 973.722,07 | 0,03 |
| 2.596.000 | ENTERGY MISSISSIPPI LLC 3.850% 01/06/2049 | USD | 2.937.710,81 | 0,10 |
| 1.810.000 | ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.300% 15/02/2053 | USD | 1.777.765,67 | 0,06 |
| 4.139.000 | ENTERPRISE PRODUCTS OPERATING LLC 3.950% 31/01/2060 | USD | 4.446.608,58 | 0,15 |
| 3.674.000 | EQUINIX INC 1.000% 15/09/2025 | USD | 3.626.736,08 | 0,12 |
| 6.250.000 | EQUINIX INC 2.900% 18/11/2026 | USD | 6.630.164,50 | 0,22 |
| 10.565.000 | ERP OPERATING LP 3.000% 01/07/2029 | USD | 11.280.287,90 | 0,37 |
| 3.750.000 | ERP OPERATING LP 3.250% 01/08/2027 | USD | 4.084.116,08 | 0,14 |
| 3.311.000 | ERP OPERATING LP 4.000% 01/08/2047 | USD | 3.905.239,61 | 0,13 |
| 1.908.000 | EVEREST REINSURANCE HOLDINGS INC 3.125% 15/10/2052 | USD | 1.863.709,98 | 0,06 |
| 9.556.000 | EVERSOURCE ENERGY 1.400% 15/08/2026 | USD | 9.531.227,50 | 0,32 |
| 3.909.000 | EVERSOURCE ENERGY 2.900% 01/10/2024 | USD | 4.128.764,49 | 0,14 |
| 6.388.000 | EXELON CORP 4.950% 15/06/2035 | USD | 7.789.321,76 | 0,26 |
| 1.547.000 | EXXON MOBIL CORP 2.019% 16/08/2024 | USD | 1.607.660,98 | 0,05 |
| 4.530.000 | EXXON MOBIL CORP 2.275% 16/08/2026 | USD | 4.757.773,93 | 0,16 |
| 1.633.000 | EXXON MOBIL CORP 2.440% 16/08/2029 | USD | 1.700.826,62 | 0,06 |
| 2.975.000 | EXXON MOBIL CORP 2.610% 15/10/2030 | USD | 3.115.960,88 | 0,10 |
| 2.170.000 | EXXON MOBIL CORP 2.995% 16/08/2039 | USD | 2.241.375,55 | 0,07 |
| 7.105.000 | EXXON MOBIL CORP 4.227% 19/03/2040 | USD | 8.438.521,68 | 0,28 |
| 4.030.314 | FEDEX CORP 2020-1 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 1.875% 20/02/2034 | USD | 3.968.039,04 | 0,13 |
| 6.196.000 | FEDEX CORP 3.875% 01/08/2042 | USD | 6.803.243,69 | 0,23 |
| 1.113.000 | FEDEX CORP 3.900% 01/02/2035 | USD | 1.255.472,90 | 0,04 |
| 4.065.000 | FEDEX CORP 4.100% 15/04/2043 | USD | 4.554.710,14 | 0,15 |
| 3.327.000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 1.150% 01/03/2026 | USD | 3.298.577,04 | 0,11 |
| 1.551.000 | FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES INC 2.250% 01/03/2031 | USD | 1.538.311,13 | 0,05 |
| 6.342.000 | FIRSTENERGY CORP 4.400% 15/07/2027 | USD | 6.947.115,08 | 0,23 |
| 8.311.000 | FISERV INC 3.500% 01/07/2029 | USD | 9.051.147,32 | 0,30 |
| 988.000 | FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.650% 01/02/2037 | USD | 1.332.511,48 | 0,04 |
| 5.291.000 | FORTINET INC 1.000% 15/03/2026 | USD | 5.212.834,10 | 0,17 |
| 1.468.000 | FORTINET INC 2.200% 15/03/2031 | USD | 1.458.046,83 | 0,05 |
| 3.719.000 | GE CAPITAL FUNDING LLC 4.050% 15/05/2027 | USD | 4.177.328,26 | 0,14 |
| 1.461.000 | GENERAL ELECTRIC CO 4.250% 01/05/2040 | USD | 1.709.746,00 | 0,06 |
| 1.562.000 | GENERAL MOTORS CO 5.950% 01/04/2049 | USD | 2.064.940,54 | 0,07 |
| 8.056.000 | GENERAL MOTORS CO 6.750% 01/04/2046 | USD | 11.419.643,59 | 0,38 |
| 1.731.000 | GEORGIA POWER CO 4.300% 15/03/2043 | USD | 2.024.711,61 | 0,07 |
| 10.301.000 | GEORGIA-PACIFIC LLC 0.625% 15/05/2024 | USD | 10.291.461,07 | 0,34 |
| 7.670.000 | GEORGIA-PACIFIC LLC 0.950% 15/05/2026 | USD | 7.581.174,57 | 0,25 |
| 3.482.000 | GEORGIA-PACIFIC LLC 2.100% 30/04/2027 | USD | 3.579.571,42 | 0,12 |
| 10.230.000 | GILEAD SCIENCES INC 0.750% 29/09/2023 | USD | 10.230.978,91 | 0,34 |
| 11.132.000 | GILEAD SCIENCES INC 3.500% 01/02/2025 | USD | 11.978.220,80 | 0,40 |
| 3.875.000 | GOLDMAN SACHS CAPITAL I 6.345% 15/02/2034 | USD | 5.437.694,77 | 0,18 |
| 430.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 21/07/2032 FRN | USD | 425.955,73 | 0,01 |
| 3.128.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 28/10/2027 FRN GMTN | USD | 3.294.207,31 | 0,11 |
| 2.614.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 3.500% 01/04/2025 | USD | 2.810.419,59 | 0,09 |
| 779.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 6.250% 01/02/2041 | USD | 1.137.774,57 | 0,04 |
| 1.684.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 6.450% 01/05/2036 | USD | 2.327.924,11 | 0,08 |
| 7.281.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 6.750% 01/10/2037 | USD | 10.422.978,59 | 0,35 |
| 5.959.000 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 12/02/2047 FRN | USD | 5.725.659,21 | 0,19 |
| 4.933.000 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 2.900% 15/09/2051 | USD | 4.766.191,25 | 0,16 |
| 2.509.000 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE 5.950% 15/10/2036 | USD | 3.426.182,59 | 0,11 |
| 5.551.000 | HASBRO INC 3.000% 19/11/2024 | USD | 5.877.812,18 | 0,19 |
| 5.440.000 | HCA INC 4.125% 15/06/2029 | USD | 6.077.174,04 | 0,20 |
| 4.162.000 | HCA INC 4.750% 01/05/2023 | USD | 4.422.942,92 | 0,15 |
| 6.463.000 | HCA INC 5.250% 15/06/2049 | USD | 8.200.073,57 | 0,27 |
| 6.402.000 | HCA INC 5.875% 01/02/2029 | USD | 7.693.679,68 | 0,26 |
| 3.085.000 | HEALTH CARE SERVICE CORP A MUTUAL LEGAL RESERVE CO 2.200% 01/06/2030 | USD | 3.084.218,29 | 0,10 |
| 3.788.000 | HERSHEY COMPANY 3.125% 15/11/2049 | USD | 4.002.929,60 | 0,13 |
| 3.288.000 | HESS CORP 4.300% 01/04/2027 | USD | 3.647.694,74 | 0,12 |
| 8.016.000 | HESS CORP 5.600% 15/02/2041 | USD | 9.964.124,87 | 0,33 |
| 11.065.000 | HOME DEPOT INC/THE 2.750% 15/09/2051 | USD | 10.799.797,29 | 0,36 |
| 6.510.000 | HOME DEPOT INC/THE 3.300% 15/04/2040 | USD | 7.056.607,72 | 0,23 |
| 3.203.000 | HORMEL FOODS CORP 1.700% 03/06/2028 | USD | 3.218.222,16 | 0,11 |
| 4.660.000 | HORMEL FOODS CORP 3.050% 03/06/2051 | USD | 4.843.207,53 | 0,16 |
| 1.130.000 | HP INC 1.450% 17/06/2026 | USD | 1.125.797,98 | 0,04 |
| 7.923.000 | HP INC 2.650% 17/06/2031 | USD | 7.845.873,71 | 0,26 |
| 2.505.000 | HP INC 6.000% 15/09/2041 | USD | 3.236.700,61 | 0,11 |
| 4.914.000 | HUMANA INC 4.625% 01/12/2042 | USD | 6.030.425,42 | 0,20 |
| 1.031.000 | INDIANA MICHIGAN POWER CO 3.250% 01/05/2051 | USD | 1.075.028,60 | 0,04 |
| 1.240.000 | INDIANA MICHIGAN POWER CO 6.050% 15/03/2037 | USD | 1.699.872,33 | 0,06 |
| 1.657.000 | INGERSOLL-RAND GLOBAL HOLDING CO LTD 4.250% 15/06/2023 | USD | 1.761.900,56 | 0,06 |
| 7.817.000 | INTEL CORP 2.800% 12/08/2041 | USD | 7.791.490,16 | 0,26 |
| 4.430.000 | INTEL CORP 3.200% 12/08/2061 | USD | 4.478.655,27 | 0,15 |
| 3.818.000 | INTEL CORP 3.700% 29/07/2025 | USD | 4.180.783,61 | 0,14 |
| 1.264.000 | INTEL CORP 4.750% 25/03/2050 | USD | 1.658.961,03 | 0,06 |
| 7.551.000 | INTERNATIONAL BUSINESS MACHINES CORP 3.500% 15/05/2029 | USD | 8.338.987,85 | 0,28 |
| 4.802.000 | IPALCO ENTERPRISES INC 3.700% 01/09/2024 | USD | 5.124.344,86 | 0,17 |
| 4.341.000 | IPALCO ENTERPRISES INC 4.250% 01/05/2030 | USD | 4.869.280,99 | 0,16 |
| 5.446.000 | J M SMUCKER CO/THE 2.125% 15/03/2032 | USD | 5.328.976,13 | 0,18 |
| 3.811.000 | J M SMUCKER CO/THE 2.750% 15/09/2041 | USD | 3.693.971,96 | 0,12 |
| 1.656.000 | JERSEY CENTRAL POWER & LIGHT CO 2.750% 01/03/2032 | USD | 1.696.574,25 | 0,06 |
| 3.378.000 | JOHNSON & JOHNSON 3.625% 03/03/2037 | USD | 3.892.569,49 | 0,13 |
| 2.750.000 | JPMORGAN CHASE & CO 01/06/2025 FRN | USD | 2.748.139,24 | 0,09 |
| 2.615.000 | JPMORGAN CHASE & CO 01/06/2028 FRN | USD | 2.670.524,03 | 0,09 |
| 3.509.000 | JPMORGAN CHASE & CO 01/06/2029 FRN | USD | 3.516.724,05 | 0,12 |
| 10.582.000 | JPMORGAN CHASE & CO 04/02/2027 FRN | USD | 10.381.215,65 | 0,34 |
| 3.948.000 | JPMORGAN CHASE & CO 04/02/2032 FRN | USD | 3.811.319,21 | 0,13 |
| 8.345.000 | JPMORGAN CHASE & CO 05/12/2029 FRN | USD | 9.600.130,56 | 0,32 |
| 19.131.000 | JPMORGAN CHASE & CO 15/10/2025 FRN | USD | 19.837.020,95 | 0,66 |
| 2.997.000 | JPMORGAN CHASE & CO 15/11/2048 FRN | USD | 3.485.838,60 | 0,12 |
| 863.000 | JPMORGAN CHASE & CO 19/11/2041 FRN | USD | 819.640,91 | 0,03 |
| 9.852.000 | JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2032 FRN | USD | 10.005.087,96 | 0,33 |
| 4.965.000 | JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2041 FRN | USD | 5.138.430,58 | 0,17 |
| 3.958.000 | JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2042 FRN | USD | 4.110.521,29 | 0,14 |
| 4.731.000 | JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2051 FRN | USD | 4.826.553,38 | 0,16 |
| 4.215.000 | JPMORGAN CHASE & CO 22/04/2052 FRN | USD | 4.440.013,73 | 0,15 |
| 7.990.000 | JPMORGAN CHASE & CO 22/09/2027 FRN | USD | 7.935.361,98 | 0,26 |
| 28.412.000 | JPMORGAN CHASE & CO 23/06/2025 FRN | USD | 28.439.902,86 | 0,93 |
| 5.479.000 | KROGER CO/THE 2.200% 01/05/2030 | USD | 5.497.978,27 | 0,18 |
| 2.947.000 | LIBERTY MUTUAL GROUP INC 15/12/2051 FRN | USD | 3.029.212,16 | 0,10 |
| 6.776.000 | LIBERTY MUTUAL GROUP INC 4.300% 01/02/2061 | USD | 6.386.711,75 | 0,21 |
| 4.788.000 | LIFE STORAGE LP 2.400% 15/10/2031 | USD | 4.744.768,38 | 0,16 |
| 12.739.000 | MAIN STREET CAPITAL CORP 3.000% 14/07/2026 | USD | 12.988.635,23 | 0,43 |
| 4.861.000 | MAIN STREET CAPITAL CORP 5.200% 01/05/2024 | USD | 5.266.619,44 | 0,17 |
| 3.018.000 | MARATHON PETROLEUM CORP 4.750% 15/09/2044 | USD | 3.531.348,19 | 0,12 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 3.861.000 | MARATHON PETROLEUM CORP 5.000% 15/09/2054 | USD | 4.627.426,92 | 0,15 |
| 5.048.000 | MARS INC 2.375% 16/07/2040 | USD | 4.815.666,20 | 0,16 |
| 1.215.000 | MCDONALD'S CORP 4.200% 01/04/2050 | USD | 1.450.165,34 | 0,05 |
| 1.517.000 | MCDONALD'S CORP 5.700% 01/02/2039 | USD | 2.051.764,94 | 0,07 |
| 3.321.000 | METROPOLITAN EDISON CO 4.000% 15/04/2025 | USD | 3.458.375,32 | 0,11 |
| 49.000 | MICROSOFT CORP 2.525% 01/06/2050 | USD | 47.317,46 | 0,00 |
| 2.207.000 | MICROSOFT CORP 2.675% 01/06/2060 | USD | 2.144.359,47 | 0,07 |
| 8.453.000 | MICROSOFT CORP 2.921% 17/03/2052 | USD | 8.793.970,10 | 0,29 |
| 2.628.000 | MICROSOFT CORP 3.041% 17/03/2062 | USD | 2.766.103,29 | 0,09 |
| 1.459.000 | MICROSOFT CORP 3.450% 08/08/2036 | USD | 1.672.087,01 | 0,06 |
| 5.042.000 | MID-AMERICA APARTMENTS LP 2.875% 15/09/2051 | USD | 4.843.594,17 | 0,16 |
| 5.805.000 | MID-AMERICA APARTMENTS LP 4.200% 15/06/2028 | USD | 6.644.900,95 | 0,22 |
| 3.018.000 | MIDAMERICAN ENERGY CO 4.250% 01/05/2046 | USD | 3.695.848,65 | 0,12 |
| 6.522.000 | MIDAMERICAN ENERGY CO 4.400% 15/10/2044 | USD | 8.057.363,91 | 0,27 |
| 1.752.000 | MISSISSIPPI POWER CO 4.250% 15/03/2042 | USD | 2.068.266,12 | 0,07 |
| 714.000 | MISSISSIPPI POWER CO 4.750% 15/10/2041 | USD | 814.317,54 | 0,03 |
| 2.700.000 | MONONGAHELA POWER CO 3.550% 15/05/2027 | USD | 2.956.632,54 | 0,10 |
| 19.409.000 | MORGAN STANLEY 01/04/2031 FRN | USD | 21.394.123,79 | 0,70 |
| 4.190.000 | MORGAN STANLEY 04/05/2027 FRN | USD | 4.202.052,07 | 0,14 |
| 2.951.000 | MORGAN STANLEY 05/04/2024 FRN | USD | 2.960.956,14 | 0,10 |
| 4.547.000 | MORGAN STANLEY 10/12/2026 FRN | USD | 4.467.159,45 | 0,15 |
| 15.089.000 | MORGAN STANLEY 20/07/2027 FRN GMTN | USD | 15.017.781,73 | 0,50 |
| 19.819.000 | MORGAN STANLEY 21/07/2032 FRN GMTN | USD | 19.481.970,77 | 0,64 |
| 2.680.000 | MORGAN STANLEY 22/01/2025 FRN GMTN | USD | 2.681.745,89 | 0,09 |
| 5.286.000 | MORGAN STANLEY 22/07/2025 FRN | USD | 5.536.745,96 | 0,18 |
| 9.774.000 | MORGAN STANLEY 28/04/2026 FRN | USD | 10.092.100,21 | 0,33 |
| 5.496.000 | MORGAN STANLEY 28/04/2032 FRN GMTN | USD | 5.275.646,84 | 0,17 |
| 1.662.000 | MORGAN STANLEY 3.625% 20/01/2027 | USD | 1.831.844,85 | 0,06 |
| 6.704.000 | MOSAIC CO 5.450% 15/11/2033 | USD | 8.388.974,11 | 0,28 |
| 1.045.000 | MOSAIC CO 5.625% 15/11/2043 | USD | 1.382.056,78 | 0,05 |
| 1.098.000 | MOSAIC CO/THE 4.875% 15/11/2041 | USD | 1.293.693,07 | 0,04 |
| 2.854.000 | MPLX LP 1.750% 01/03/2026 | USD | 2.871.311,96 | 0,10 |
| 3.824.000 | MPLX LP 2.650% 15/08/2030 | USD | 3.841.820,03 | 0,13 |
| 2.590.000 | MPLX LP 4.000% 15/02/2025 | USD | 2.808.942,41 | 0,09 |
| 1.558.000 | MPLX LP 4.700% 15/04/2048 | USD | 1.795.484,86 | 0,06 |
| 8.217.000 | MPLX LP 5.200% 01/03/2047 | USD | 9.974.541,11 | 0,33 |
| 1.733.000 | MPLX LP 5.200% 01/12/2047 | USD | 2.092.089,04 | 0,07 |
| 2.180.000 | MPLX LP 5.500% 15/02/2049 | USD | 2.765.585,08 | 0,09 |
| 6.586.000 | MYLAN INC 5.200% 15/04/2048 | USD | 8.058.646,39 | 0,27 |
| 594.000 | MYLAN INC/PA 5.400% 29/11/2043 | USD | 737.101,35 | 0,02 |
| 5.010.000 | NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE FINANCE CORP 20/04/2046 FRN | USD | 5.509.448,55 | 0,18 |
| 3.253.000 | NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE FINANCE CORP 3.050% 25/04/2027 | USD | 3.516.033,55 | 0,12 |
| 2.557.000 | NATIONAL RURAL UTILITIES COOPERATIVE FINANCE CORP 4.023% 01/11/2032 | USD | 2.973.378,97 | 0,10 |
| 8.225.000 | NESTLE HOLDINGS INC 1.500% 14/09/2028 | USD | 8.140.884,90 | 0,27 |
| 2.749.000 | NESTLE HOLDINGS INC 2.625% 14/09/2051 | USD | 2.702.141,45 | 0,09 |
| 12.241.000 | NEW YORK STATE ELECTRIC & GAS CORP 3.250% 01/12/2026 | USD | 13.232.841,96 | 0,44 |
| 3.642.000 | NORFOLK SOUTHERN CORP 3.950% 01/10/2042 | USD | 4.187.837,94 | 0,14 |
| 4.023.000 | NORTHWESTERN MUTUAL GLOBAL FUNDING 0.800% 14/01/2026 | USD | 3.952.944,36 | 0,13 |
| 5.498.000 | NORTHWESTERN MUTUAL GLOBAL FUNDING 1.700% 01/06/2028 | USD | 5.518.682,10 | 0,18 |
| 8.574.000 | NVIDIA CORP 1.550% 15/06/2028 | USD | 8.541.343,78 | 0,28 |
| 10.766.000 | NVIDIA CORP 2.000% 15/06/2031 | USD | 10.725.619,53 | 0,36 |
| 2.718.000 | NVIDIA CORP 3.500% 01/04/2040 | USD | 3.017.836,88 | 0,10 |
| 1.686.000 | NVIDIA CORP 3.700% 01/04/2060 | USD | 1.947.488,72 | 0,06 |
| 6.405.000 | OAKTREE SPECIALTY LENDING CORP 2.700% 15/01/2027 | USD | 6.430.379,24 | 0,21 |
| 4.819.000 | OLD REPUBLIC INTERNATIONAL CORP 3.850% 11/06/2051 | USD | 5.220.728,71 | 0,17 |
| 2.268.000 | ONEOK PARTNERS LP 6.125% 01/02/2041 | USD | 2.914.146,42 | 0,10 |
| 2.320.000 | ORACLE CORP 2.950% 15/05/2025 | USD | 2.460.480,27 | 0,08 |
| 2.883.000 | ORACLE CORP 3.850% 01/04/2060 | USD | 2.935.956,73 | 0,10 |
| 3.208.000 | ORACLE CORP 4.000% 15/11/2047 | USD | 3.406.673,81 | 0,11 |
| 7.020.000 | ORACLE CORP 4.125% 15/05/2045 | USD | 7.574.586,32 | 0,25 |
| 5.738.000 | OWL ROCK TECHNOLOGY FINANCE CORP 6.750% 30/06/2025 | USD | 6.577.426,77 | 0,22 |
| 7.013.000 | PACIFICORP 4.100% 01/02/2042 | USD | 8.106.786,61 | 0,27 |
| 4.007.000 | PACIFICORP 4.150% 15/02/2050 | USD | 4.770.623,73 | 0,16 |
| 6.786.000 | PECO ENERGY CO 2.850% 15/09/2051 | USD | 6.695.684,18 | 0,22 |
| 6.842.000 | PERKINELMER INC 3.300% 15/09/2029 | USD | 7.371.981,53 | 0,24 |
| 1.765.000 | PFIZER INC 3.900% 15/03/2039 | USD | 2.063.878,55 | 0,07 |
| 2.747.000 | PHILLIPS 66 0.900% 15/02/2024 | USD | 2.747.154,00 | 0,09 |
| 5.655.000 | PHILLIPS 66 2.150% 15/12/2030 | USD | 5.519.766,22 | 0,18 |
| 1.639.000 | PIEDMONT NATURAL GAS CO INC 3.350% 01/06/2050 | USD | 1.685.406,38 | 0,06 |
| 1.605.000 | PIEDMONT NATURAL GAS CO INC 3.600% 01/09/2025 | USD | 1.716.313,75 | 0,06 |
| 6.010.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 3.550% 15/12/2029 | USD | 6.320.920,26 | 0,21 |
| 1.987.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.300% 31/01/2043 | USD | 2.030.693,53 | 0,07 |
| 855.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 4.500% 15/12/2026 | USD | 955.201,87 | 0,03 |
| 985.000 | PLAINS ALL AMERICAN PIPELINE LP / PAA FINANCE CORP 5.150% 01/06/2042 | USD | 1.108.495,15 | 0,04 |
| 7.797.000 | PPG INDUSTRIES INC 1.200% 15/03/2026 | USD | 7.753.417,81 | 0,26 |
| 5.443.000 | PROSPECT CAPITAL CORP 3.437% 15/10/2028 | USD | 5.291.699,68 | 0,18 |
| 2.732.000 | PUBLIC SERVICE CO OF NEW HAMPSHIRE 3.500% 01/11/2023 | USD | 2.885.505,89 | 0,10 |
| 2.274.000 | PUBLIC SERVICE CO OF NEW HAMPSHIRE 3.600% 01/07/2049 | USD | 2.567.254,15 | 0,09 |
| 3.885.000 | PUBLIC SERVICE CO OF OKLAHOMA 2.200% 15/08/2031 | USD | 3.838.641,73 | 0,13 |
| 3.885.000 | PUBLIC SERVICE CO OF OKLAHOMA 3.150% 15/08/2051 | USD | 3.877.370,02 | 0,13 |
| 1.417.000 | PUBLIC SERVICE ELECTRIC AND GAS CO 1.900% 15/08/2031 | USD | 1.395.255,03 | 0,05 |
| 2.748.000 | QUANTA SERVICES INC 0.950% 01/10/2024 | USD | 2.748.474,19 | 0,09 |
| 2.755.000 | QUANTA SERVICES INC 2.350% 15/01/2032 | USD | 2.697.485,90 | 0,09 |
| 5.271.000 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 3.200% 15/03/2024 | USD | 5.583.345,81 | 0,19 |
| 28.000 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 3.650% 16/08/2023 | USD | 29.462,90 | 0,00 |
| 2.381.000 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 4.350% 15/04/2047 | USD | 2.870.954,28 | 0,10 |
| 3.537.000 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 4.500% 01/06/2042 | USD | 4.349.944,65 | 0,14 |
| 369.000 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 4.800% 15/12/2043 | USD | 463.738,21 | 0,02 |
| 716.000 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 5.400% 01/05/2035 | USD | 934.887,54 | 0,03 |
| 2.097.000 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 5.700% 15/04/2040 | USD | 2.875.565,35 | 0,10 |
| 2.265.000 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP 6.125% 15/07/2038 | USD | 3.187.920,14 | 0,11 |
| 500.000 | RELX CAPITAL INC 3.500% 16/03/2023 | USD | 520.979,94 | 0,02 |
| 1.535.000 | REPUBLIC SERVICES INC 0.875% 15/11/2025 | USD | 1.513.531,51 | 0,05 |
| 2.201.000 | REPUBLIC SERVICES INC 1.450% 15/02/2031 | USD | 2.060.915,15 | 0,07 |
| 9.058.000 | SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 4.200% 15/03/2028 | USD | 10.119.343,16 | 0,34 |
| 2.176.000 | SABINE PASS LIQUEFACTION LLC 4.500% 15/05/2030 | USD | 2.510.243,59 | 0,08 |
| 2.903.000 | SABRA HEALTH CARE LP 3.200% 01/12/2031 | USD | 2.853.898,45 | 0,09 |
| 4.475.000 | SALESFORCE.COM INC 1.950% 15/07/2031 | USD | 4.458.360,12 | 0,15 |
| 3.748.000 | SALESFORCE.COM INC 2.700% 15/07/2041 | USD | 3.734.622,79 | 0,12 |
| 2.679.000 | SALESFORCE.COM INC 2.900% 15/07/2051 | USD | 2.680.823,94 | 0,09 |
| 675.000 | SIERRA PACIFIC POWER CO 2.600% 01/05/2026 | USD | 712.690,44 | 0,02 |
| 9.974.000 | SOUTH JERSEY INDUSTRIES INC 5.020% 15/04/2031 | USD | 10.873.580,79 | 0,36 |
| 3.010.000 | SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.050% 15/03/2042 | USD | 3.222.934,05 | 0,11 |
| 2.989.000 | SOUTHERN CALIFORNIA EDISON CO 4.125% 01/03/2048 | USD | 3.258.546,85 | 0,11 |
| 1.930.000 | SOUTHERN CO GAS CAPITAL CORP 4.400% 30/05/2047 | USD | 2.271.849,18 | 0,08 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.393.000 | SOUTHERN CO GAS CAPITAL CORP 5.875% 15/03/2041 | USD | 3.290.204,00 | 0,11 |
| 10.301.000 | SOUTHERN CO/THE 15/01/2051 FRN | USD | 10.896.180,65 | 0,36 |
| 2.852.000 | S&P GLOBAL INC 1.250% 15/08/2030 | USD | 2.686.315,26 | 0,09 |
| 4.106.000 | TEACHERS INSURANCE & ANNUITY ASSOCIATION OF AMERICA 3.300% 15/05/2050 | USD | 4.305.866,12 | 0,14 |
| 3.680.000 | TELEDYNE TECHNOLOGIES INC 1.600% 01/04/2026 | USD | 3.702.816,40 | 0,12 |
| 2.540.000 | TIME WARNER ENTERTAINMENT CO LP 8.375% 15/07/2033 | USD | 3.750.176,47 | 0,12 |
| 11.572.000 | T-MOBILE USA INC 2.250% 15/02/2026 | USD | 11.695.711,85 | 0,39 |
| 6.309.000 | T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029 | USD | 6.372.641,91 | 0,21 |
| 4.098.000 | T-MOBILE USA INC 2.625% 15/04/2026 | USD | 4.187.464,59 | 0,14 |
| 6.681.000 | T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031 | USD | 6.740.846,26 | 0,22 |
| 6.827.000 | T-MOBILE USA INC 3.375% 15/04/2029 | USD | 7.127.914,63 | 0,24 |
| 3.540.000 | T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031 | USD | 3.738.360,57 | 0,12 |
| 11.289.000 | T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031 | USD | 11.914.637,28 | 0,40 |
| 1.130.000 | TRANE TECHNOLOGIES GLOBAL HOLDING CO LTD 3.750% 21/08/2028 | USD | 1.254.534,84 | 0,04 |
| 2.515.000 | TRANSCONTINENTAL GAS PIPE LINE CO LLC 3.250% 15/05/2030 | USD | 2.692.144,13 | 0,09 |
| 12.909.000 | TRUIST BANK 15/03/2028 FRN | USD | 12.541.247,89 | 0,42 |
| 5.799.000 | TRUIST FINANCIAL CORP 02/03/2027 FRN | USD | 5.772.916,33 | 0,19 |
| 5.448.000 | TRUIST FINANCIAL CORP 07/06/2029 FRN | USD | 5.446.960,74 | 0,18 |
| 4.215.000 | TUCSON ELECTRIC POWER CO 4.000% 15/06/2050 | USD | 4.908.021,70 | 0,16 |
| 4.175.000 | UNILEVER CAPITAL CORP 1.750% 12/08/2031 | USD | 4.074.012,09 | 0,14 |
| 2.770.000 | UNILEVER CAPITAL CORP 2.625% 12/08/2051 | USD | 2.672.299,97 | 0,09 |
| 6.071.000 | UNION ELECTRIC CO 2.150% 15/03/2032 | USD | 6.026.998,18 | 0,20 |
| 2.233.000 | UNION PACIFIC CORP 3.550% 15/08/2039 | USD | 2.475.953,28 | 0,08 |
| 743.000 | UNION PACIFIC CORP 3.600% 15/09/2037 | USD | 826.374,44 | 0,03 |
| 1.410.000 | UNION PACIFIC CORP 3.799% 06/04/2071 | USD | 1.588.094,75 | 0,05 |
| 4.299.000 | UNION PACIFIC CORP 3.839% 20/03/2060 | USD | 4.933.544,44 | 0,16 |
| 1.502.000 | UNION PACIFIC CORP 4.100% 15/09/2067 | USD | 1.773.547,69 | 0,06 |
| 1.144.000 | UNITED AIRLINES INC 4.375% 15/04/2026 | USD | 1.176.153,05 | 0,04 |
| 763.000 | UNITED AIRLINES INC 4.625% 15/04/2029 | USD | 788.769,04 | 0,03 |
| 2.069.737 | UNITED AIRLINES 2012-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.150% 11/04/2024 | USD | 2.182.248,90 | 0,07 |
| 1.902.721 | UNITED AIRLINES 2013-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.300% 15/08/2025 | USD | 2.038.354,78 | 0,07 |
| 2.984.235 | UNITED AIRLINES 2014-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.750% 03/09/2026 | USD | 3.133.292,36 | 0,10 |
| 3.425.558 | UNITED AIRLINES 2016-1 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 3.100% 07/07/2028 | USD | 3.568.982,95 | 0,12 |
| 419.716 | UNITED AIRLINES 2016-2 CLASS AA PASS THROUGH TRUST 2.875% 07/10/2028 | USD | 429.336,35 | 0,01 |
| 785.691 | UNITED AIRLINES 2018-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.700% 01/03/2030 | USD | 798.417,50 | 0,03 |
| 278.885 | UNITED AIRLINES 2019-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.550% 25/08/2031 | USD | 297.533,56 | 0,01 |
| 2.268.604 | UNITED AIRLINES 2020-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 5.875% 15/10/2027 | USD | 2.529.908,54 | 0,08 |
| 1.285.528 | UNITED AIRLINES 2020-1 CLASS B PASS THROUGH TRUST 4.875% 15/01/2026 | USD | 1.360.136,88 | 0,05 |
| 3.096.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.375% 15/09/2024 | USD | 3.082.696,89 | 0,10 |
| 4.015.900 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 0.750% 31/08/2026 | USD | 3.973.231,06 | 0,13 |
| 733.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.125% 31/08/2028 | USD | 724.410,16 | 0,02 |
| 16.089.500 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.250% 15/08/2031 | USD | 15.699.832,42 | 0,52 |
| 6.484.000 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 1.750% 15/08/2041 | USD | 6.200.325,00 | 0,21 |
| 17.906.700 | UNITED STATES TREASURY NOTE/BOND 2.375% 15/05/2051 | USD | 19.115.402,25 | 0,63 |
| 2.500.000 | UNITEDHEALTH GROUP INC 1.150% 15/05/2026 | USD | 2.502.948,50 | 0,08 |
| 612.000 | UNITEDHEALTH GROUP INC 2.900% 15/05/2050 | USD | 613.337,46 | 0,02 |
| 6.037.000 | UNITEDHEALTH GROUP INC 3.050% 15/05/2041 | USD | 6.247.216,55 | 0,21 |
| 2.168.000 | UNITEDHEALTH GROUP INC 3.250% 15/05/2051 | USD | 2.311.420,31 | 0,08 |
| 1.690.000 | UNITEDHEALTH GROUP INC 3.500% 15/08/2039 | USD | 1.866.526,03 | 0,06 |
| 2.375.000 | UNITEDHEALTH GROUP INC 3.700% 15/08/2049 | USD | 2.698.844,34 | 0,09 |
| 932.000 | UNITEDHEALTH GROUP INC 4.450% 15/12/2048 | USD | 1.180.615,93 | 0,04 |
| 3.244.000 | UNUM GROUP 4.125% 15/06/2051 | USD | 3.284.123,38 | 0,11 |
| 1.676.000 | UPJOHN INC 4.000% 22/06/2050 | USD | 1.781.428,44 | 0,06 |
| 3.757.083 | US AIRWAYS 2010-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 6.250% 22/04/2023 | USD | 3.864.920,64 | 0,13 |
| 8.901.458 | US AIRWAYS 2012-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 5.900% 01/10/2024 | USD | 9.377.244,38 | 0,31 |
| 10.735.740 | US AIRWAYS 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.625% 03/06/2025 | USD | 10.721.583,83 | 0,36 |
| 5.236.271 | US AIRWAYS 2013-1 CLASS A PASS THROUGH TRUST 3.950% 15/11/2025 | USD | 5.327.571,74 | 0,18 |
| 6.002.000 | USAA CAPITAL CORP 0.500% 01/05/2024 | USD | 5.986.617,23 | 0,20 |
| 3.153.000 | VENTAS REALTY LP 2.500% 01/09/2031 | USD | 3.115.948,72 | 0,10 |
| 22.130.319 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.355% 15/03/2032 | USD | 21.910.472,21 | 0,72 |
| 1.901.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.650% 20/11/2040 | USD | 1.792.959,61 | 0,06 |
| 1.159.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 2.987% 30/10/2056 | USD | 1.077.399,11 | 0,04 |
| 22.273.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 3.700% 22/03/2061 | USD | 23.544.152,18 | 0,77 |
| 3.416.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.329% 21/09/2028 | USD | 3.929.582,82 | 0,13 |
| 24.390.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.500% 10/08/2033 | USD | 29.041.782,02 | 0,95 |
| 6.249.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.812% 15/03/2039 | USD | 7.759.088,41 | 0,26 |
| 977.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 4.862% 21/08/2046 | USD | 1.243.954,92 | 0,04 |
| 110.000 | VERIZON COMMUNICATIONS INC 5.012% 15/04/2049 | USD | 144.070,21 | 0,00 |
| 1.167.000 | VIACOMCBS INC 5.500% 15/05/2033 | USD | 1.475.301,57 | 0,05 |
| 3.452.000 | VIACOMCBS INC 5.850% 01/09/2043 | USD | 4.717.353,00 | 0,16 |
| 2.094.000 | VIATRIS INC 3.850% 22/06/2040 | USD | 2.246.028,25 | 0,07 |
| 4.014.000 | VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.500% 15/03/2027 | USD | 4.422.476,48 | 0,15 |
| 2.030.000 | VIRGINIA ELECTRIC & POWER CO 3.800% 01/04/2028 | USD | 2.269.262,64 | 0,08 |
| 8.491.000 | VMWARE INC 0.600% 15/08/2023 | USD | 8.500.042,15 | 0,28 |
| 11.279.000 | VMWARE INC 1.400% 15/08/2026 | USD | 11.229.255,10 | 0,37 |
| 4.012.000 | WALT DISNEY CO/THE 1.750% 13/01/2026 | USD | 4.115.665,02 | 0,14 |
| 2.329.000 | WALT DISNEY CO/THE 2.000% 01/09/2029 | USD | 2.351.442,66 | 0,08 |
| 778.000 | WALT DISNEY CO/THE 4.625% 23/03/2040 | USD | 976.894,54 | 0,03 |
| 3.001.000 | WALT DISNEY CO/THE 4.750% 15/11/2046 | USD | 3.899.933,37 | 0,13 |
| 2.987.000 | WALT DISNEY CO/THE 6.550% 15/03/2033 | USD | 4.195.712,22 | 0,14 |
| 1.645.000 | WALT DISNEY CO/THE 8.500% 23/02/2025 | USD | 2.032.026,08 | 0,07 |
| 26.522.000 | WASTE MANAGEMENT INC 1.500% 15/03/2031 | USD | 24.944.847,52 | 0,82 |
| 1.879.000 | WASTE MANAGEMENT INC 2.950% 01/06/2041 | USD | 1.913.337,60 | 0,06 |
| 2.652.000 | WELLS FARGO & CO 04/04/2051 FRN | USD | 3.570.074,19 | 0,12 |
| 2.186.000 | WELLS FARGO & CO 30/04/2041 FRN | USD | 2.249.985,79 | 0,07 |
| 7.646.000 | WESTROCK RKT LLC 4.000% 01/03/2023 | USD | 7.943.364,26 | 0,26 |
| 4.441.000 | WEYERHAEUSER CO 8.500% 15/01/2025 | USD | 5.461.733,61 | 0,18 |
| 6.550.000 | WILLIAMS COS INC/THE 3.750% 15/06/2027 | USD | 7.220.851,33 | 0,24 |
| 4.182.000 | WILLIAMS COS INC/THE 4.550% 24/06/2024 | USD | 4.563.577,52 | 0,15 |
| 4.690.000 | WILLIAMS COS INC/THE 5.100% 15/09/2045 | USD | 5.809.558,67 | 0,19 |
| 4.241.000 | WRKCO INC 3.000% 15/06/2033 | USD | 4.424.037,53 | 0,15 |
| 1.685.000 | WRKCO INC 4.650% 15/03/2026 | USD | 1.911.679,76 | 0,06 |
| 4.119.000 | WW GRAINGER INC 3.750% 15/05/2046 | USD | 4.711.723,03 | 0,16 |
| 6.336.000 | XYLEM INC/NY 3.250% 01/11/2026 | USD | 6.884.028,71 | 0,23 |
| | | | **2.473.550.614,00** | **82,01** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 2.400.000 | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 2.250% 17/03/2028 | USD | 2.391.647,62 | 0,08 |
| 2.190.000 | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 2.875% 17/03/2031 | USD | 2.201.187,62 | 0,07 |
| 3.510.000 | ANGLO AMERICAN CAPITAL PLC 5.625% 01/04/2030 | USD | 4.236.023,46 | 0,14 |
| 13.329.000 | ASTRAZENECA PLC 0.700% 08/04/2026 | USD | 13.040.600,69 | 0,42 |
| 7.737.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 0.500% 05/05/2023 | USD | 7.728.448,06 | 0,26 |
| 7.963.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 0.800% 03/05/2024 | USD | 7.933.671,40 | 0,26 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 5.960.000 | COCA-COLA EUROPACIFIC PARTNERS PLC 1.500% 15/01/2027 | USD | 5.916.745,18 | 0,20 |
| 5.629.000 | DIAGEO CAPITAL PLC 2.125% 24/10/2024 | USD | 5.863.034,51 | 0,19 |
| 8.820.000 | DIAGEO CAPITAL PLC 3.500% 18/09/2023 | USD | 9.332.569,89 | 0,31 |
| 20.876.000 | HSBC HOLDINGS PLC 22/09/2028 FRN | USD | 20.862.672,34 | 0,68 |
| 4.788.000 | HSBC HOLDINGS PLC 24/05/2027 FRN | USD | 4.758.745,70 | 0,16 |
| 5.973.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 05/02/2026 FRN | USD | 6.194.599,61 | 0,21 |
| 1.360.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 09/07/2025 FRN | USD | 1.466.095,57 | 0,05 |
| 7.821.000 | LSEGA FINANCING PLC 1.375% 06/04/2026 | USD | 7.790.175,17 | 0,26 |
| 6.416.000 | LSEGA FINANCING PLC 2.500% 06/04/2031 | USD | 6.517.455,25 | 0,22 |
| 2.499.000 | LSEGA FINANCING PLC 3.200% 06/04/2041 | USD | 2.580.974,25 | 0,09 |
| 7.831.000 | NATWEST GROUP PLC 22/03/2025 FRN | USD | 8.450.630,62 | 0,28 |
| 8.293.000 | NATWEST GROUP PLC 28/11/2035 FRN | USD | 8.306.867,14 | 0,28 |
| 6.832.000 | ROYALTY PHARMA PLC 1.200% 02/09/2025 | USD | 6.784.618,78 | 0,22 |
| 3.834.000 | ROYALTY PHARMA PLC 3.300% 02/09/2040 | USD | 3.831.976,64 | 0,13 |
| 13.191.000 | VODAFONE GROUP PLC 04/06/2081 FRN | USD | 13.618.837,55 | 0,45 |
| 5.045.000 | VODAFONE GROUP PLC 5.125% 19/06/2059 | USD | 6.574.027,60 | 0,22 |
| | | | **156.381.604,65** | **5,18** |
| | **Schweiz** | | | |
| 5.464.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG FRN PERP | USD | 5.716.931,35 | 0,19 |
| 5.927.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG FRN PERP | USD | 5.808.067,40 | 0,19 |
| 6.723.000 | CREDIT SUISSE GROUP AG FRN PERP | USD | 7.382.791,72 | 0,24 |
| 8.200.000 | UBS AG 5.125% 15/05/2024 | USD | 8.971.588,02 | 0,30 |
| 5.522.000 | UBS GROUP AG FRN PERP | USD | 5.529.591,26 | 0,18 |
| 14.259.000 | UBS GROUP AG FRN PERP | USD | 15.474.132,30 | 0,52 |
| | | | **48.883.102,05** | **1,62** |
| | **Niederlande** | | | |
| 8.600.000 | ABN AMRO BANK NV 27/03/2028 FRN | USD | 8.988.591,77 | 0,30 |
| 12.403.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 24/09/2026 FRN | USD | 12.231.294,36 | 0,40 |
| 7.275.000 | COOPERATIEVE RABOBANK UA 4.375% 04/08/2025 | USD | 8.061.283,82 | 0,27 |
| 418.000 | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 3.250% 06/04/2050 | USD | 444.881,29 | 0,01 |
| 5.870.000 | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 4.000% 10/05/2046 | USD | 6.903.534,42 | 0,23 |
| 1.601.000 | SHELL INTERNATIONAL FINANCE BV 4.125% 11/05/2035 | USD | 1.885.404,03 | 0,06 |
| 7.330.000 | SIEMENS FINANCIERINGSMAATSCHAPPIJ NV 2.875% 11/03/2041 | USD | 7.443.276,13 | 0,25 |
| | | | **45.958.265,82** | **1,52** |
| | **Australien** | | | |
| 10.075.000 | AUSTRALIA & NEW ZEALAND BANKING GROUP LTD/UNITED KINGDOM FRN PERP | USD | 11.801.847,14 | 0,39 |
| 5.669.000 | NBN CO LTD 1.450% 05/05/2026 | USD | 5.653.779,87 | 0,19 |
| 2.595.000 | NBN CO LTD 1.625% 08/01/2027 | USD | 2.587.857,96 | 0,09 |
| 2.735.000 | NBN CO LTD 2.500% 08/01/2032 | USD | 2.726.509,96 | 0,09 |
| 2.268.000 | NEWCREST FINANCE PTY LTD 3.250% 13/05/2030 | USD | 2.414.166,79 | 0,08 |
| 2.946.000 | NEWCREST FINANCE PTY LTD 4.200% 13/05/2050 | USD | 3.359.398,42 | 0,11 |
| 6.640.000 | SANTOS FINANCE LTD 3.649% 29/04/2031 | USD | 6.751.023,06 | 0,22 |
| | | | **35.294.583,20** | **1,17** |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 19.233.000 | TSMC GLOBAL LTD 1.250% 23/04/2026 | USD | 19.054.789,14 | 0,63 |
| 13.705.000 | TSMC GLOBAL LTD 2.250% 23/04/2031 | USD | 13.661.015,58 | 0,45 |
| | | | **32.715.804,72** | **1,08** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 3.155.000 | AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 2.125% 21/02/2026 | USD | 3.125.457,75 | 0,10 |
| 2.718.000 | AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 2.750% 21/02/2028 | USD | 2.699.252,89 | 0,09 |
| 2.659.000 | AVOLON HOLDINGS FUNDING LTD 2.875% 15/02/2025 | USD | 2.735.315,08 | 0,09 |
| 9.539.000 | XLIT LTD 4.450% 31/03/2025 | USD | 10.582.858,97 | 0,35 |
| 5.166.000 | XLIT LTD 5.500% 31/03/2045 | USD | 7.129.736,08 | 0,24 |
| | | | **26.272.620,77** | **0,87** |
| | **Italien** | | | |
| 16.014.000 | INTESA SANPAOLO SPA 4.950% 01/06/2042 | USD | 16.573.228,58 | 0,55 |
| 5.607.000 | UNICREDIT SPA 03/06/2032 FRN | USD | 5.664.417,08 | 0,19 |
| | | | **22.237.645,66** | **0,74** |
| | **Kanada** | | | |
| 1.855.000 | BANK OF NOVA SCOTIA/THE FRN PERP | USD | 1.999.537,98 | 0,07 |
| 3.870.000 | BANK OF NOVA SCOTIA/THE 0.700% 15/04/2024 | USD | 3.868.206,91 | 0,13 |
| 2.246.000 | BROOKFIELD FINANCE INC 4.700% 20/09/2047 | USD | 2.722.467,90 | 0,09 |
| 5.016.000 | NUTRIEN LTD 2.950% 13/05/2030 | USD | 5.295.311,65 | 0,18 |
| 4.195.000 | NUTRIEN LTD 3.500% 01/06/2023 | USD | 4.367.769,73 | 0,14 |
| 3.277.000 | NUTRIEN LTD 3.950% 13/05/2050 | USD | 3.728.208,00 | 0,12 |
| | | | **21.981.502,17** | **0,73** |
| | **Frankreich** | | | |
| 1.844.000 | BNP PARIBAS SA 19/04/2032 FRN | USD | 1.883.825,00 | 0,06 |
| 5.212.000 | ORANGE SA 9.000% 01/03/2031 | USD | 8.103.814,30 | 0,27 |
| 2.840.000 | TOTAL CAPITAL INTERNATIONAL SA 2.829% 10/01/2030 | USD | 3.026.866,60 | 0,10 |
| 2.023.000 | TOTALENERGIES CAPITAL INTERNATIONAL SA 2.986% 29/06/2041 | USD | 2.059.990,29 | 0,07 |
| 1.622.000 | TOTALENERGIES CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.127% 29/05/2050 | USD | 1.633.140,79 | 0,05 |
| 1.441.000 | TOTALENERGIES CAPITAL INTERNATIONAL SA 3.386% 29/06/2060 | USD | 1.508.353,09 | 0,05 |
| | | | **18.215.990,07** | **0,60** |
| | **Spanien** | | | |
| 4.000.000 | BANCO SANTANDER SA FRN PERP | USD | 4.377.598,20 | 0,15 |
| 4.800.000 | BANCO SANTANDER SA FRN PERP | USD | 4.893.715,34 | 0,16 |
| 8.136.000 | CELLNEX FINANCE CO SA 3.875% 07/07/2041 | USD | 8.105.866,29 | 0,27 |
| | | | **17.377.179,83** | **0,58** |
| | **Dänemark** | | | |
| 2.950.000 | DANSKE BANK AS 1.226% 22/06/2024 | USD | 2.978.532,61 | 0,10 |
| 10.279.000 | DANSKE BANK AS 20/12/2025 FRN | USD | 10.916.466,06 | 0,36 |
| 2.389.000 | DANSKE BANK AS 4.375% 12/06/2028 | USD | 2.664.199,73 | 0,09 |
| | | | **16.559.198,40** | **0,55** |
| | **Bermuda** | | | |
| 8.260.000 | TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD 0.800% 01/08/2023 | USD | 8.254.780,34 | 0,28 |
| 6.917.000 | TRITON CONTAINER INTERNATIONAL LTD 3.150% 15/06/2031 | USD | 6.976.466,42 | 0,23 |
| | | | **15.231.246,76** | **0,51** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 3.418.064 | DELTA AIR LINES INC / SKYMILES IP LTD 4.500% 20/10/2025 | USD | 3.659.619,68 | 0,12 |
| 7.526.019 | DELTA AIR LINES INC / SKYMILES IP LTD 4.750% 20/10/2028 | USD | 8.395.204,20 | 0,29 |
| | | | **12.054.823,88** | **0,41** |
| | **Irland** | | | |
| 5.920.000 | GE CAPITAL INTERNATIONAL FUNDING CO UNLIMITED CO 4.418% 15/11/2035 | USD | 7.116.532,82 | 0,23 |
| 3.520.000 | STERIS IRISH FINCO UNLTD CO 3.750% 15/03/2051 | USD | 3.801.564,80 | 0,13 |
| | | | **10.918.097,62** | **0,36** |
| | **Japan** | | | |
| 3.125.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.025% 09/07/2040 | USD | 3.164.170,41 | 0,10 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.604.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 3.375% 09/07/2060 | USD | 2.737.240,14 | 0,09 |
| 3.971.000 | TAKEDA PHARMACEUTICAL CO LTD 5.000% 26/11/2028 | USD | 4.738.289,25 | 0,16 |
| | | | **10.639.699,80** | **0,35** |
| | **Finnland** | | | |
| 3.113.000 | NORDEA BANK ABP FRN PERP | USD | 3.057.380,81 | 0,10 |
| | | | **3.057.380,81** | **0,10** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 930.000 | TRANE TECHNOLOGIES LUXEMBOURG FINANCE SA 3.550% 01/11/2024 | USD | 999.202,69 | 0,03 |
| | | | **999.202,69** | **0,03** |
| | | | **2.968.328.562,90** | **98,41** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **2.975.168.374,20** | **98,64** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 9.060.179,37 | USD | 7.671.598,02 | EUR | 19/10/2021 | 9.060.179,37 | 166.552,59 |
| 1.166.305,86 | USD | 16.995.606,36 | ZAR | 19/10/2021 | 1.166.305,86 | 39.057,24 |
| 1.362.816,86 | USD | 1.857.334,07 | AUD | 19/10/2021 | 1.362.816,86 | 21.085,86 |
| 2.671.757,07 | ZAR | 176.034,07 | USD | 04/10/2021 | 176.034,07 | 1.550,31 |
| 171.621,31 | AUD | 123.369,97 | USD | 05/10/2021 | 123.369,97 | 601,17 |
| 915.161,91 | ZAR | 60.616,78 | USD | 01/10/2021 | 60.616,78 | 211,53 |
| 6.289,01 | USD | 54.499,90 | SEK | 19/10/2021 | 6.289,01 | 58,72 |
| 999,96 | GBP | 1.342,48 | USD | 19/10/2021 | 1.342,48 | 5,84 |
| 24.205,86 | SEK | 2.767,74 | USD | 01/10/2021 | 2.767,74 | (0,90) |
| 1.342,45 | USD | 999,96 | GBP | 04/10/2021 | 1.342,45 | (5,85) |
| 19.212,76 | AUD | 13.903,31 | USD | 01/10/2021 | 13.903,31 | (24,98) |
| 12.687,62 | USD | 192.566,35 | ZAR | 04/10/2021 | 12.687,62 | (111,74) |
| 65.925,25 | EUR | 76.575,47 | USD | 04/10/2021 | 76.575,47 | (171,40) |
| 224.746,52 | EUR | 262.357,85 | USD | 01/10/2021 | 262.357,85 | (1.887,87) |
| 5.255.880,65 | SEK | 611.386,47 | USD | 19/10/2021 | 611.386,47 | (10.547,81) |
| 18.127.569,56 | CHF | 19.848.797,76 | USD | 19/10/2021 | 19.848.797,76 | (408.836,41) |
| 58.399.645,23 | AUD | 43.057.525,20 | USD | 19/10/2021 | 43.057.525,20 | (869.845,79) |
| 310.883.352,61 | ZAR | 21.499.162,85 | USD | 19/10/2021 | 21.499.162,85 | (879.549,59) |
| 1.202.992.386,64 | EUR | 1.427.216.095,60 | USD | 19/10/2021 | 1.427.216.095,60 | (32.595.924,33) |
| | | | | | **1.524.559.556,72** | **(34.537.783,41)** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| (429) | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 68.304.843,75 | 1.613.078,12 |
| 83 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 15.858.187,50 | (351.263,92) |
| (9) | US 10YR NOTE (CBT) 21/12/2021 | USD | 1.184.484,38 | 12.855,34 |
| (1.193) | US 10YR ULTRA FUTURE 21/12/2021 | USD | 173.283.250,00 | 2.639.046,88 |
| 792 | US 2YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 174.283.312,90 | (99.921,47) |
| 714 | US 5YR NOTE (CBT) 31/12/2021 | USD | 87.637.922,23 | (509.392,02) |
| | | | **520.552.000,76** | **3.304.402,93** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(31.233.380,48)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **2.975.168.374,20** | **98,64** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(31.233.380,48)** | **(1,04)** |
| **Bankverbindlichkeiten** | **(1.074.076,36)** | **(0,04)** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **73.186.007,25** | **2,44** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **3.016.046.924,61** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 389.125.911,31 |
| | 30.09.2020 | USD | 508.797.428,20 |
| | 30.09.2019 | USD | 840.532.420,86 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 19.163,50 |
| | 30.09.2020 | EUR | 14.628,78 |
| | 30.09.2019 | EUR | 14.386,07 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 242,35 |
| | 30.09.2020 | USD | 187,20 |
| | 30.09.2019 | USD | 171,15 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 222.983,68 |
| | 30.09.2020 | CZK | 173.847,89 |
| | 30.09.2019 | CZK | 163.379,28 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 8.275,40 |
| | 30.09.2020 | EUR | 6.471,61 |
| | 30.09.2019 | EUR | 6.078,06 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 810,51 |
| | 30.09.2020 | EUR | 624,14 |
| | 30.09.2019 | EUR | 619,41 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 207,20 |
| | 30.09.2020 | USD | 161,50 |
| | 30.09.2019 | USD | 149,00 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 374,65 |
| | 30.09.2020 | USD | 290,14 |
| | 30.09.2019 | USD | 265,96 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 449,98 |
| | 30.09.2020 | EUR | 346,33 |
| | 30.09.2019 | EUR | 343,39 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 186,53 |
| | 30.09.2020 | USD | 146,13 |
| | 30.09.2019 | USD | 135,49 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | CZK | 23.563,75 |
| | 30.09.2020 | CZK | 18.618,47 |
| | 30.09.2019 | CZK | 17.798,21 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 170,50 |
| | 30.09.2020 | USD | 132,90 |
| | 30.09.2019 | USD | 122,66 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | 1.829 |
| | 30.09.2020 | | 12.688 |
| | 30.09.2019 | | 34.150 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 876.633 |
| | 30.09.2020 | 942.088 |
| | 30.09.2019 | 1.061.553 |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 3.908 |
| | 30.09.2020 | 4.545 |
| | 30.09.2019 | 4.627 |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1.708 |
| | 30.09.2020 | 1.912 |
| | 30.09.2019 | 2.014 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 9 |
| | 30.09.2020 | 10 |
| | 30.09.2019 | 5 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 282.478 |
| | 30.09.2020 | 319.092 |
| | 30.09.2019 | 391.510 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1.915 |
| | 30.09.2020 | 1.915 |
| | 30.09.2019 | 1.938 |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 4.448 |
| | 30.09.2020 | 8.569 |
| | 30.09.2019 | 22.304 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 33.706 |
| | 30.09.2020 | 28.675 |
| | 30.09.2019 | 32.672 |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 9.747 |
| | 30.09.2020 | 5.853 |
| | 30.09.2019 | 6.185 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 8.449 |
| | 30.09.2020 | 11.898 |
| | 30.09.2019 | 13.909 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,69% |
| Capitalisation I Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 0,71% |
| Capitalisation I Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 0,71% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,60% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 0,95% |
| Capitalisation V (EUR) | 30.09.2021 | 1,51% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,10% |
| Capitalisation X Hedged (i) (CZK) | 30.09.2021 | 2,12% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,60% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | 107,68% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **383.747.638,28** |
| Aktien | | 383.747.638,28 |
| **Bankguthaben** | | **4.037.512,48** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **255.508,46** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **81.170.709,99** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***469.211.369,21*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(78.417.233,49)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(1.668.224,41)** |
| Devisentermingeschäfte | | (1.517.956,91) |
| Futures | | (150.267,50) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(80.085.457,90)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***389.125.911,31*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **3.987.163,22** |
| Dividenden | | 3.985.318,34 |
| Bankzinsen | | 1.844,88 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(3.719.499,68)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (2.740.675,56) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (893.954,95) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (13.724,41) |
| Abonnementsteuer | 9 | (71.144,76) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **267.663,54** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 133.450.791,22 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (7.357.481,36) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 1.988.989,24 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (217.790,51) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 1.115.473,62 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (1.126.831,72) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (13.003.719,70) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 788.640,12 |
| **Ergebnis** | | **115.905.734,45** |
| Zeichnungen | | 30.269.418,51 |
| Rücknahmen | | (265.846.669,85) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 508.797.428,20 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***389.125.911,31*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 2.492 | ACUITY BRANDS INC | USD | 432.038,04 | 0,11 |
| 8.154 | ADOBE INC | USD | 4.694.420,88 | 1,21 |
| 9.817 | ADVANCED MICRO DEVICES INC | USD | 1.010.169,30 | 0,26 |
| 22.156 | AGILENT TECHNOLOGIES INC | USD | 3.490.234,68 | 0,90 |
| 5.714 | ALIGN TECHNOLOGY INC | USD | 3.802.267,02 | 0,98 |
| 6.988 | ALPHABET INC - A | USD | 18.682.557,76 | 4,80 |
| 3.304 | AMAZON.COM INC | USD | 10.853.772,16 | 2,79 |
| 11.991 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 3.167.062,92 | 0,81 |
| 30.604 | AMETEK INC | USD | 3.795.202,04 | 0,98 |
| 13.802 | ANTHEM INC | USD | 5.145.385,60 | 1,32 |
| 135.307 | APPLE INC | USD | 19.145.940,50 | 4,91 |
| 35.894 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 4.620.634,62 | 1,19 |
| 79.460 | AVNET INC | USD | 2.937.636,20 | 0,75 |
| 83.619 | BANK OF AMERICA CORP | USD | 3.549.626,55 | 0,91 |
| 22.347 | BERKSHIRE HATHAWAY INC - B | USD | 6.099.390,18 | 1,57 |
| 74.467 | BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | USD | 4.406.212,39 | 1,13 |
| 97.610 | BRIXMOR PROPERTY GROUP INC | USD | 2.158.157,10 | 0,55 |
| 8.793 | CBRE GROUP INC - A | USD | 856.086,48 | 0,22 |
| 40.509 | CHEVRON CORP | USD | 4.109.638,05 | 1,06 |
| 115.002 | CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE | USD | 6.259.558,86 | 1,60 |
| 64.737 | CITIGROUP INC | USD | 4.543.242,66 | 1,17 |
| 109.244 | CNO FINANCIAL GROUP INC | USD | 2.571.603,76 | 0,65 |
| 63.794 | COCA-COLA CO | USD | 3.347.271,18 | 0,86 |
| 113.829 | COMCAST CORP - A | USD | 6.366.455,97 | 1,63 |
| 12.693 | COMMVAULT SYSTEMS INC | USD | 955.909,83 | 0,25 |
| 43.869 | CONOCOPHILLIPS | USD | 2.973.002,13 | 0,76 |
| 30.554 | COSTAR GROUP INC | USD | 2.629.477,24 | 0,68 |
| 58.633 | CSX CORP | USD | 1.743.745,42 | 0,45 |
| 80.136 | DANA INC | USD | 1.782.224,64 | 0,46 |
| 7.445 | DECKERS OUTDOOR CORP | USD | 2.681.689,00 | 0,69 |
| 9.008 | DEERE & CO | USD | 3.018.310,56 | 0,78 |
| 114.481 | DROPBOX INC - A | USD | 3.345.134,82 | 0,85 |
| 67.762 | DUPONT DE NEMOURS INC | USD | 4.607.138,38 | 1,18 |
| 14.479 | EDWARDS LIFESCIENCES CORP | USD | 1.639.167,59 | 0,42 |
| 10.084 | EMCOR GROUP INC | USD | 1.163.491,92 | 0,30 |
| 39.097 | ENTERGY CORP | USD | 3.882.723,07 | 1,00 |
| 4.708 | EPAM SYSTEMS INC | USD | 2.685.819,84 | 0,69 |
| 5.690 | ESTEE LAUDER COS INC/THE - A | USD | 1.706.601,70 | 0,44 |
| 35.697 | FACEBOOK INC - A | USD | 12.115.204,83 | 3,11 |
| 73.433 | GAMING AND LEISURE PROPERTIES INC | USD | 3.401.416,56 | 0,87 |
| 43.473 | INCYTE CORP | USD | 2.990.072,94 | 0,77 |
| 20.226 | INGEVITY CORP | USD | 1.443.529,62 | 0,37 |
| 19.011 | INTERPUBLIC GROUP OF COS INC/THE | USD | 697.133,37 | 0,18 |
| 4.379 | INTUIT INC | USD | 2.362.514,29 | 0,61 |
| 65.068 | IRIDIUM COMMUNICATIONS INC | USD | 2.592.959,80 | 0,67 |
| 39.421 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 6.366.491,50 | 1,64 |
| 8.850 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 1.448.656,50 | 0,37 |
| 13.249 | KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | USD | 2.176.678,21 | 0,56 |
| 7.705 | LAM RESEARCH CORP | USD | 4.385.300,75 | 1,13 |
| 29.212 | LENNAR CORP - A | USD | 2.736.580,16 | 0,70 |
| 77.268 | LOEWS CORP | USD | 4.167.063,24 | 1,07 |
| 8.430 | LPL FINANCIAL HOLDINGS INC | USD | 1.321.486,80 | 0,34 |
| 37.752 | MARATHON PETROLEUM CORP | USD | 2.333.451,12 | 0,60 |
| 86.148 | MERCK & CO INC | USD | 6.470.576,28 | 1,66 |
| 93.956 | MICROSOFT CORP | USD | 26.488.075,52 | 6,81 |
| 35.289 | MINERALS TECHNOLOGIES INC | USD | 2.464.583,76 | 0,63 |
| 78.153 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A | USD | 4.546.941,54 | 1,17 |
| 6.903 | MSCI INC -A | USD | 4.199.371,02 | 1,08 |
| 78.510 | NATIONAL FUEL GAS CO | USD | 4.123.345,20 | 1,06 |
| 11.753 | NEXTERA ENERGY INC | USD | 922.845,56 | 0,24 |
| 24.650 | NIKE INC - B | USD | 3.579.919,50 | 0,92 |
| 5.094 | NVIDIA CORP | USD | 1.055.273,04 | 0,27 |
| 99 | NVR INC | USD | 474.613,92 | 0,12 |
| 10.822 | OLD DOMINION FREIGHT LINE INC | USD | 3.094.875,56 | 0,80 |
| 23.047 | OLD REPUBLIC INTERNATIONAL CORP | USD | 533.077,11 | 0,14 |
| 5.851 | O'REILLY AUTOMOTIVE INC | USD | 3.575.312,06 | 0,92 |
| 25.981 | PAYPAL HOLDINGS INC | USD | 6.760.516,01 | 1,74 |
| 40.408 | PEPSICO INC | USD | 6.077.767,28 | 1,56 |
| 40.039 | PROLOGIS INC | USD | 5.022.091,77 | 1,29 |
| 38.201 | PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GROUP INC | USD | 2.326.440,90 | 0,60 |
| 98.308 | PURE STORAGE INC - A | USD | 2.473.429,28 | 0,64 |
| 39.399 | QUALCOMM INC | USD | 5.081.683,02 | 1,31 |
| 9.555 | REGAL BELOIT CORP | USD | 1.436.498,70 | 0,37 |
| 8.133 | ROKU INC - A | USD | 2.548.475,55 | 0,65 |
| 10.563 | ROPER TECHNOLOGIES INC | USD | 4.712.471,19 | 1,21 |
| 33.022 | RYDER SYSTEM INC | USD | 2.731.249,62 | 0,70 |
| 4.334 | SBA COMMUNICATIONS CORP - A | USD | 1.432.690,38 | 0,37 |
| 48.630 | STARBUCKS CORP | USD | 5.364.375,30 | 1,38 |
| 72.875 | SYNCHRONY FINANCIAL | USD | 3.562.130,00 | 0,92 |
| 20.773 | SYNNEX CORP | USD | 2.162.469,30 | 0,56 |
| 37.838 | SYNOVUS FINANCIAL CORP | USD | 1.660.709,82 | 0,43 |
| 3.242 | TESLA INC | USD | 2.514.106,16 | 0,65 |
| 7.538 | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | USD | 4.306.685,54 | 1,11 |
| 50.464 | TRADEWEB MARKETS INC - A | USD | 4.076.481,92 | 1,05 |
| 46.577 | TRI POINTE HOMES INC | USD | 979.048,54 | 0,25 |
| 19.534 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 7.632.715,16 | 1,96 |
| 9.307 | VALERO ENERGY CORP | USD | 656.794,99 | 0,17 |
| 13.572 | VERTEX PHARMACEUTICALS INC | USD | 2.461.825,08 | 0,63 |
| 36.843 | VIACOMCBS INC - B | USD | 1.455.666,93 | 0,37 |
| 36.778 | VISA INC - A | USD | 8.192.299,50 | 2,11 |
| 25.422 | WALMART INC | USD | 3.543.318,36 | 0,91 |
| 107.673 | WELLS FARGO & CO | USD | 4.997.103,93 | 1,28 |
| 16.771 | WOODWARD INC | USD | 1.898.477,20 | 0,49 |
| | | | **368.993.872,23** | **94,83** |
| **Irland** | | | | |
| 29.955 | ALLEGION PLC | USD | 3.959.451,90 | 1,02 |
| 6.567 | EATON CORP PLC | USD | 980.518,77 | 0,25 |
| 48.050 | MEDTRONIC PLC | USD | 6.023.067,50 | 1,55 |
| | | | **10.963.038,17** | **2,82** |
| **Bermuda** | | | | |
| 79.788 | GENPACT LTD | USD | 3.790.727,88 | 0,97 |
| | | | **3.790.727,88** | **0,97** |
| | | | **383.747.638,28** | **98,62** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **383.747.638,28** | **98,62** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 593.475,91 | USD | 500.651,43 | EUR | 19/10/2021 | 593.475,91 | 13.074,41 |
| 230.603,78 | USD | 4.952.525,32 | CZK | 19/10/2021 | 230.603,78 | 4.243,42 |
| 15.344.379,72 | EUR | 18.206.427,25 | USD | 19/10/2021 | 18.206.427,25 | (417.801,39) |
| 1.143.386.916,60 | CZK | 53.377.169,65 | USD | 19/10/2021 | 53.377.169,65 | (1.117.473,35) |
| | | | | | **72.407.676,59** | **(1.517.956,91)** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Future auf Aktienindizes** | | | | |
| 23 | S&P500 EMINI FUTURE 17/12/2021 | USD | 4.942.412,50 | (150.267,50) |
| | | | **4.942.412,50** | **(150.267,50)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(1.668.224,41)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **383.747.638,28** | **98,62** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(1.668.224,41)** | **(0,43)** |
| **Bankguthaben** | **4.037.512,48** | **1,04** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **3.008.984,96** | **0,77** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **389.125.911,31** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Factor Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 39.885.314,01 |
| | 30.09.2020 | USD | 46.251.284,79 |
| | 30.09.2019 | USD | 49.066.923,67 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 29.710,12 |
| | 30.09.2020 | USD | 28.977,93 |
| | 30.09.2019 | USD | 26.887,03 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 12,97 |
| | 30.09.2020 | EUR | 12,51 |
| | 30.09.2019 | EUR | 12,50 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.420,36 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.390,35 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.294,66 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.394,78 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.366,64 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.273,87 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 387,11 |
| | 30.09.2020 | USD | 386,38 |
| | 30.09.2019 | USD | 367,61 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 81 |
| | 30.09.2020 | | 86 |
| | 30.09.2019 | | 97 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 414.329 |
| | 30.09.2020 | | 552.043 |
| | 30.09.2019 | | 660.291 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 14.865 |
| | 30.09.2020 | | 16.172 |
| | 30.09.2019 | | 19.552 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | | 3.887 |
| | 30.09.2020 | | 5.689 |
| | 30.09.2019 | | 5.152 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | | 12.153 |
| | 30.09.2020 | | 13.953 |
| | 30.09.2019 | | 15.175 |
| **Dividende** | | | |
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 7,60 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 0,49% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | | 0,56% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 0,85% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | | 0,95% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | | 0,85% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 69,19% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US Factor Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **38.095.431,28** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 38.095.431,28 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **190.272,45** |
| Credit Default Swaps | | 190.272,45 |
| **Bankguthaben** | | **878.245,77** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **699.046,81** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **403.367,51** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***40.266.363,82*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(76.221,68)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(304.828,13)** |
| Futures | | (304.828,13) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(381.049,81)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***39.885.314,01*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **1.346.772,27** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 1.177.492,88 |
| Zinsen auf Swaps | | 152.500,00 |
| Sonstige Erträge | 10 | 16.779,39 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(337.990,27)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (254.984,46) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (62.971,02) |
| Abonnementsteuer | 9 | (19.815,31) |
| Bankzinsen | | (219,48) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **1.008.782,00** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 1.245.014,40 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (240.529,20) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 871.068,37 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.551.337,47) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 8.252,78 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (8.715,83) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (523.584,39) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 140.939,82 |
| **Ergebnis** | | **949.890,48** |
| Zeichnungen | | 3.881.908,54 |
| Rücknahmen | | (11.095.152,24) |
| Ausschüttung | | (102.617,56) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 46.251.284,79 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***39.885.314,01*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Factor Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|

**Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente**

### Anleihen und andere Schuldtitel

**Vereinigte Staaten**

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 200.000 | ABB FINANCE USA INC 2.875% 08/05/2022 | USD | 203.114,06 | 0,51 |
| 200.000 | ALLY FINANCIAL INC 8.000% 01/11/2031 | USD | 283.325,06 | 0,71 |
| 200.000 | AMERICAN HONDA FINANCE CORP 2.900% 16/02/2024 | USD | 210.552,28 | 0,53 |
| 200.000 | AMERICAN WATER CAPITAL CORP 6.593% 15/10/2037 | USD | 293.397,62 | 0,74 |
| 150.000 | ANHEUSER-BUSCH INBEV WORLDWIDE INC 8.000% 15/11/2039 | USD | 243.775,26 | 0,61 |
| 250.000 | ANTARES HOLDINGS LP 6.000% 15/08/2023 | USD | 270.763,70 | 0,68 |
| 230.000 | APPALACHIAN POWER CO 3.400% 01/06/2025 | USD | 246.519,21 | 0,62 |
| 170.000 | APPALACHIAN POWER CO 7.000% 01/04/2038 | USD | 250.824,73 | 0,63 |
| 200.000 | APPLE INC 2.400% 13/01/2023 | USD | 205.031,93 | 0,51 |
| 200.000 | APPLE INC 3.350% 09/02/2027 | USD | 220.425,14 | 0,55 |
| 200.000 | APPLE INC 4.650% 23/02/2046 | USD | 260.252,62 | 0,65 |
| 240.000 | ARES CAPITAL CORP 4.250% 01/03/2025 | USD | 257.820,63 | 0,65 |
| 63.000 | ARIZONA PUBLIC SERVICE CO 2.550% 15/09/2026 | USD | 65.872,86 | 0,17 |
| 66.000 | ARROW ELECTRONICS INC 3.875% 12/01/2028 | USD | 71.374,44 | 0,18 |
| 243.000 | AUTONATION INC 4.500% 01/10/2025 | USD | 269.836,41 | 0,68 |
| 63.000 | AVNET INC 4.625% 15/04/2026 | USD | 70.190,90 | 0,18 |
| 170.000 | BANK OF AMERICA CORP 05/03/2024 FRN | USD | 177.223,11 | 0,44 |
| 800.000 | BANK OF AMERICA CORP 23/07/2024 FRN | USD | 846.602,18 | 2,11 |
| 250.000 | BANK OF AMERICA NA 25/01/2023 FRN | USD | 252.346,74 | 0,63 |
| 250.000 | BLACKSTONE SECURED LENDING FUND 3.650% 14/07/2023 | USD | 260.717,07 | 0,65 |
| 153.000 | BLOCK FINANCIAL LLC 5.250% 01/10/2025 | USD | 172.978,18 | 0,43 |
| 213.000 | BLUE CROSS AND BLUE SHIELD OF MINNESOTA 3.790% 01/05/2025 | USD | 227.973,66 | 0,57 |
| 93.000 | BOARDWALK PIPELINES LP 5.950% 01/06/2026 | USD | 108.899,02 | 0,27 |
| 242.000 | BROADCOM INC 3.459% 15/09/2026 | USD | 261.548,39 | 0,66 |
| 33.000 | BROADCOM INC 3.469% 15/04/2034 | USD | 34.125,30 | 0,09 |
| 200.000 | BROADCOM INC 5.000% 15/04/2030 | USD | 233.711,24 | 0,59 |
| 150.000 | BURLINGTON RESOURCES LLC 5.950% 15/10/2036 | USD | 205.870,96 | 0,52 |
| 243.000 | CABOT CORP 3.400% 15/09/2026 | USD | 259.243,39 | 0,65 |
| 230.000 | CADENCE DESIGN SYSTEMS INC 4.375% 15/10/2024 | USD | 250.947,26 | 0,63 |
| 200.000 | CATERPILLAR INC 6.050% 15/08/2036 | USD | 287.594,83 | 0,72 |
| 200.000 | CENTERPOINT ENERGY RESOURCES CORP 0.700% 02/03/2023 | USD | 200.003,49 | 0,50 |
| 200.000 | CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING LLC / CHARTER COMMUNICATIONS OPERATING CAPITAL 5.050% 30/03/2029 | USD | 233.572,19 | 0,59 |
| 115.000 | CINCINNATI FINANCIAL CORP 6.920% 15/05/2028 | USD | 149.436,71 | 0,37 |
| 200.000 | CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE 5.900% 15/02/2039 | USD | 289.093,58 | 0,72 |
| 200.000 | CITADEL LP 5.375% 17/01/2023 | USD | 210.003,42 | 0,53 |
| 800.000 | CITIGROUP INC 24/07/2023 FRN | USD | 815.596,18 | 2,03 |
| 139.000 | COMCAST CORP 2.887% 01/11/2051 | USD | 133.282,26 | 0,33 |
| 230.000 | COMMONSPIRIT HEALTH 4.200% 01/08/2023 | USD | 244.301,63 | 0,61 |
| 156.354 | CONTINENTAL AIRLINES 2012-2 CLASS A PASS THROUGH TRUST 4.000% 29/10/2024 | USD | 163.905,50 | 0,41 |
| 230.000 | DELL INTERNATIONAL LLC / EMC CORP 6.020% 15/06/2026 | USD | 274.312,94 | 0,69 |
| 200.000 | DEVON ENERGY CORP 7.875% 30/09/2031 | USD | 282.101,03 | 0,71 |
| 200.000 | DIAGEO INVESTMENT CORP 8.000% 15/09/2022 | USD | 214.576,91 | 0,54 |
| 200.000 | DIAMONDBACK ENERGY INC 0.900% 24/03/2023 | USD | 200.001,91 | 0,50 |
| 250.000 | DISCOVER BANK 09/08/2028 FRN | USD | 266.269,80 | 0,67 |
| 210.000 | DOMTAR CORP 6.750% 15/02/2044 | USD | 220.493,97 | 0,55 |
| 116.000 | DOW CHEMICAL CO/THE 9.400% 15/05/2039 | USD | 208.781,57 | 0,52 |
| 191.000 | EXELON GENERATION CO LLC 6.250% 01/10/2039 | USD | 243.896,89 | 0,61 |
| 250.000 | EXPEDIA GROUP INC 3.600% 15/12/2023 | USD | 264.594,57 | 0,66 |
| 180.000 | FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.690% 01/03/2040 | USD | 254.803,49 | 0,64 |
| 170.000 | FLORIDA POWER & LIGHT CO 5.950% 01/02/2038 | USD | 241.524,03 | 0,61 |
| 230.000 | FS KKR CAPITAL CORP 4.750% 15/05/2022 | USD | 235.046,03 | 0,59 |
| 400.000 | GENERAL ELECTRIC CO 2.700% 09/10/2022 | USD | 409.390,26 | 1,03 |
| 200.000 | GENERAL MOTORS CO 6.250% 02/10/2043 | USD | 269.041,92 | 0,67 |
| 200.000 | GLP CAPITAL LP / GLP FINANCING II INC 5.375% 15/04/2026 | USD | 227.598,41 | 0,57 |
| 200.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 21/07/2032 FRN | USD | 198.118,94 | 0,50 |
| 200.000 | GOLDMAN SACHS GROUP INC/THE 24/07/2023 FRN | USD | 203.882,32 | 0,51 |
| 250.000 | GOLUB CAPITAL BDC INC 3.375% 15/04/2024 | USD | 261.301,84 | 0,66 |
| 200.000 | HALLIBURTON CO 7.450% 15/09/2039 | USD | 291.412,52 | 0,73 |
| 200.000 | HCA INC 5.000% 15/03/2024 | USD | 219.364,69 | 0,55 |
| 240.000 | HESS CORP 4.300% 01/04/2027 | USD | 266.255,09 | 0,67 |
| 200.000 | HEWLETT PACKARD ENTERPRISE CO 6.350% 15/10/2045 | USD | 269.388,42 | 0,68 |
| 212.000 | HOLLYFRONTIER CORP 5.875% 01/04/2026 | USD | 243.156,22 | 0,61 |
| 210.000 | JABIL INC 4.700% 15/09/2022 | USD | 218.395,21 | 0,55 |
| 15.000 | JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC 6.625% 23/10/2043 | USD | 20.267,83 | 0,05 |
| 200.000 | JEFFERIES GROUP LLC 6.250% 15/01/2036 | USD | 268.833,79 | 0,67 |
| 400.000 | JOHN DEERE CAPITAL CORP 3.050% 06/01/2028 | USD | 434.541,10 | 1,09 |
| 230.000 | JPMORGAN CHASE & CO 23/04/2029 FRN | USD | 257.295,34 | 0,65 |
| 200.000 | JPMORGAN CHASE & CO 24/03/2031 FRN | USD | 233.454,33 | 0,59 |
| 200.000 | JPMORGAN CHASE & CO 5.500% 15/10/2040 | USD | 272.254,77 | 0,68 |
| 200.000 | JPMORGAN CHASE & CO 6.400% 15/05/2038 | USD | 291.468,17 | 0,73 |
| 233.000 | KKR GROUP FINANCE CO III LLC 5.125% 01/06/2044 | USD | 301.221,60 | 0,76 |
| 200.000 | MAIN STREET CAPITAL CORP 5.200% 01/05/2024 | USD | 216.688,72 | 0,54 |
| 200.000 | MARATHON PETROLEUM CORP 6.500% 01/03/2041 | USD | 275.370,31 | 0,69 |
| 200.000 | MARVELL TECHNOLOGY INC 4.200% 22/06/2023 | USD | 211.037,40 | 0,53 |
| 240.000 | MERCURY GENERAL CORP 4.400% 15/03/2027 | USD | 270.967,45 | 0,68 |
| 150.000 | METLIFE INC 10.750% 01/08/2039 | USD | 262.919,05 | 0,66 |
| 200.000 | MICORN TECHNOLOGY INC 4.975% 06/02/2026 | USD | 228.766,47 | 0,57 |
| 600.000 | MICROSOFT CORP 2.700% 12/02/2025 | USD | 635.826,13 | 1,58 |
| 600.000 | MORGAN STANLEY 24/01/2029 FRN GMTN | USD | 664.254,26 | 1,67 |
| 200.000 | MORGAN STANLEY 3.125% 23/01/2023 GMTN | USD | 207.076,03 | 0,52 |
| 200.000 | NATIONAL FUEL GAS CO 5.500% 15/01/2026 | USD | 230.499,87 | 0,58 |
| 250.000 | NSTAR ELECTRIC CO 2.375% 15/10/2022 | USD | 253.985,39 | 0,64 |
| 63.000 | OCHSNER CLINIC FOUNDATION 5.897% 15/05/2045 | USD | 88.872,23 | 0,22 |
| 230.000 | OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST 4.000% 15/07/2022 | USD | 235.272,35 | 0,59 |
| 236.000 | OFFICE PROPERTIES INCOME TRUST 4.250% 15/05/2024 | USD | 250.229,54 | 0,63 |
| 240.000 | OMEGA HEALTHCARE INVESTORS INC 4.750% 15/01/2028 | USD | 269.909,10 | 0,68 |
| 200.000 | ONEOK PARTNERS LP 6.850% 15/10/2037 | USD | 272.225,97 | 0,68 |
| 400.000 | ORACLE CORP 6.125% 08/07/2039 | USD | 541.959,16 | 1,36 |
| 200.000 | OWL ROCK CAPITAL CORP 5.250% 15/04/2024 | USD | 217.966,37 | 0,55 |
| 160.000 | PROVIDENCE ST JOSEPH HEALTH OBLIGATED GROUP 3.744% 01/10/2047 | USD | 181.985,58 | 0,46 |
| 400.000 | PRUDENTIAL FINANCIAL INC 15/09/2042 FRN | USD | 415.334,25 | 1,04 |
| 220.000 | RELIANCE STEEL & ALUMINUM CO 4.500% 15/04/2023 | USD | 230.871,08 | 0,58 |
| 230.000 | RETAIL PROPERTIES OF AMERICA INC 4.000% 15/03/2025 | USD | 243.346,84 | 0,61 |
| 240.000 | SABRA HEALTH CARE LP 5.125% 15/08/2026 | USD | 268.561,77 | 0,67 |
| 350.000 | SAMMONS FINANCIAL GROUP INC 4.450% 12/05/2027 | USD | 390.885,10 | 0,98 |
| 203.000 | SANTANDER HOLDINGS USA INC 4.500% 17/07/2025 | USD | 223.606,65 | 0,56 |
| 400.000 | SIMON PROPERTY GROUP LP 2.200% 01/02/2031 | USD | 393.658,82 | 0,99 |
| 200.000 | SIXTH STREET SPECIALTY LENDING INC 3.875% 01/11/2024 | USD | 212.968,27 | 0,53 |
| 200.000 | SL GREEN REALTY CORP 4.500% 01/12/2022 | USD | 206.553,61 | 0,52 |
| 250.000 | SOUTHERN CO/THE 15/03/2057 FRN | USD | 253.181,74 | 0,63 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Factor Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 240.000 | TANGER PROPERTIES LP 3.875% 15/07/2027 | USD | 259.316,28 | 0,65 |
| 240.000 | TAPESTRY INC 4.125% 15/07/2027 | USD | 262.565,37 | 0,66 |
| 50.000 | TIME WARNER CABLE LLC 7.300% 01/07/2038 | USD | 71.737,28 | 0,18 |
| 230.000 | TIMKEN CO/THE 3.875% 01/09/2024 | USD | 245.712,95 | 0,62 |
| 200.000 | TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 2.625% 10/01/2023 | USD | 205.920,40 | 0,52 |
| 200.000 | TOYOTA MOTOR CREDIT CORP 3.450% 20/09/2023 GMTN | USD | 211.846,05 | 0,53 |
| 200.000 | TRUIST BANK 02/08/2024 FRN | USD | 211.881,31 | 0,53 |
| 400.000 | US BANK NA/CINCINNATI OH 2.800% 27/01/2025 | USD | 423.755,74 | 1,06 |
| 240.000 | VALMONT INDUSTRIES INC 5.000% 01/10/2044 | USD | 295.074,34 | 0,74 |
| 200.000 | VERISK ANALYTICS INC 4.125% 12/09/2022 | USD | 206.981,16 | 0,52 |
| 200.000 | VIACOM INC 6.875% 30/04/2036 | USD | 286.630,67 | 0,72 |
| 200.000 | VOYA FINANCIAL INC 15/05/2053 FRN | USD | 210.822,47 | 0,53 |
| 250.000 | WABTEC CORP 3.450% 15/11/2026 | USD | 267.900,87 | 0,67 |
| 40.000 | WHIRLPOOL CORP 4.700% 01/06/2022 | USD | 41.108,49 | 0,10 |
| 200.000 | XILINX INC 2.950% 01/06/2024 | USD | 210.773,31 | 0,53 |
| | | | **29.271.905,25** | **73,39** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 400.000 | BARCLAYS PLC 16/05/2024 FRN | USD | 423.410,52 | 1,06 |
| 600.000 | HSBC HOLDINGS PLC 13/03/2028 FRN | USD | 663.918,92 | 1,67 |
| 400.000 | LLOYDS BANKING GROUP PLC 07/11/2028 FRN | USD | 435.536,31 | 1,09 |
| | | | **1.522.865,75** | **3,82** |
| | **Japan** | | | |
| 230.000 | MITSUBISHI UFJ FINANCIAL GROUP INC 3.455% 02/03/2023 | USD | 239.928,61 | 0,60 |
| 400.000 | MIZUHO FINANCIAL GROUP INC 11/09/2024 FRN | USD | 424.840,26 | 1,07 |
| 200.000 | ORIX CORP 2.900% 18/07/2022 | USD | 203.752,94 | 0,51 |
| 400.000 | SUMITOMO MITSUI FINANCIAL GROUP INC 3.202% 17/09/2029 | USD | 421.203,22 | 1,05 |
| | | | **1.289.725,03** | **3,23** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 240.000 | ALIBABA GROUP HOLDING LTD 2.800% 06/06/2023 | USD | 247.988,05 | 0,62 |
| 220.000 | AZURE ORBIT IV INTERNATIONAL FINANCE LTD 3.750% 25/01/2023 EMTN | USD | 226.791,28 | 0,57 |
| 200.000 | FIBRIA OVERSEAS FINANCE LTD 5.500% 17/01/2027 | USD | 228.745,15 | 0,57 |
| 250.000 | TENCENT MUSIC ENTERTAINMENT GROUP 1.375% 03/09/2025 | USD | 244.793,34 | 0,62 |
| 200.000 | WEIBO CORP 3.500% 05/07/2024 | USD | 209.015,98 | 0,52 |
| | | | **1.157.333,80** | **2,90** |
| | **Australien** | | | |
| 250.000 | NEWCASTLE COAL INFRASTRUCTURE GROUP PTY LTD 4.400% 29/09/2027 | USD | 255.976,90 | 0,65 |
| 210.000 | QBE INSURANCE GROUP LTD 24/11/2043 FRN | USD | 235.857,26 | 0,59 |
| 200.000 | RIO TINTO FINANCE USA LTD 7.125% 15/07/2028 | USD | 266.572,74 | 0,67 |
| 200.000 | WESTPAC BANKING CORP 3.400% 25/01/2028 | USD | 221.088,51 | 0,55 |
| | | | **979.495,41** | **2,46** |
| | **Jungferninseln** | | | |
| 220.000 | CNPC GENERAL CAPITAL LTD 3.950% 19/04/2022 | USD | 223.743,41 | 0,56 |
| 220.000 | SF HOLDING INVESTMENT LTD 4.125% 26/07/2023 | USD | 230.974,66 | 0,58 |
| 220.000 | STATE GRID OVERSEAS INVESTMENT BVI LTD 2.750% 04/05/2022 | USD | 222.661,09 | 0,56 |
| 230.000 | YUNNAN ENERGY INVESTMENT OVERSEAS FINANCE CO LTD 4.250% 14/11/2022 | USD | 223.147,93 | 0,56 |
| | | | **900.527,09** | **2,26** |
| | **Bermuda** | | | |
| 50.000 | AIRCASTLE LTD 4.400% 25/09/2023 | USD | 53.245,96 | 0,13 |
| 205.000 | ALLIED WORLD ASSURANCE CO HOLDINGS LTD 4.350% 29/10/2025 | USD | 223.162,98 | 0,56 |
| 230.000 | ASPEN INSURANCE HOLDINGS LTD 4.650% 15/11/2023 | USD | 248.191,68 | 0,62 |
| 240.000 | ATHENE HOLDING LTD 4.125% 12/01/2028 | USD | 266.554,07 | 0,67 |
| | | | **791.154,69** | **1,98** |
| | **Niederlande** | | | |
| 200.000 | LYB INTERNATIONAL FINANCE BV 5.250% 15/07/2043 | USD | 257.001,31 | 0,64 |
| 220.000 | SYNGENTA FINANCE NV 3.125% 28/03/2022 | USD | 221.992,81 | 0,56 |
| | | | **478.994,12** | **1,20** |
| | **Kanada** | | | |
| 200.000 | BANK OF MONTREAL 05/10/2028 FRN | USD | 213.419,97 | 0,54 |
| 200.000 | NUTRIEN LTD 3.000% 01/04/2025 | USD | 211.813,91 | 0,53 |
| | | | **425.233,88** | **1,07** |
| | **Chile** | | | |
| 240.000 | ENEL GENERACION CHILE SA 4.250% 15/04/2024 | USD | 256.106,95 | 0,64 |
| | | | **256.106,95** | **0,64** |
| | **Irland** | | | |
| 200.000 | AERCAP IRELAND CAPITAL DAC / AERCAP GLOBAL AVIATION TRUST 3.875% 23/01/2028 | USD | 214.176,79 | 0,54 |
| | | | **214.176,79** | **0,54** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 200.000 | TYCO ELECTRONICS GROUP SA 3.450% 01/08/2024 | USD | 212.820,96 | 0,53 |
| | | | **212.820,96** | **0,53** |
| | **Mexiko** | | | |
| 200.000 | FOMENTO ECONOMICO MEXICANO SAB DE CV 2.875% 10/05/2023 | USD | 206.557,20 | 0,52 |
| | | | **206.557,20** | **0,52** |
| | **Spanien** | | | |
| 200.000 | BANCO SANTANDER SA 2.958% 25/03/2031 | USD | 205.538,15 | 0,52 |
| | | | **205.538,15** | **0,52** |
| | **Frankreich** | | | |
| 121.000 | LEGRAND FRANCE SA 8.500% 15/02/2025 | USD | 150.020,64 | 0,38 |
| | | | **150.020,64** | **0,38** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 30.000 | BROADCOM CORP / BROADCOM CAYMAN FINANCE LTD 3.875% 15/01/2027 | USD | 32.975,57 | 0,07 |
| | | | **32.975,57** | **0,07** |
| | | | **38.095.431,28** | **95,51** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **38.095.431,28** | **95,51** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Factor Credit

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Bezeich-nung | Verkauf / Kauf | Zinssatz (%) | Fälligkeits-datum | Währung | Nennwert | Swap-Wert in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Credit Default Swap** | | | | | | |
| CDX NORTH AMERICA INVESTMENT GRADE SERIES 35 VERSION 1 | Verkauf | 1,000 | 20/12/2030 | USD | 15.000.000,00 | 190.272,45 |
| | | | | | | **190.272,45** |

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Zins-Futures** | | | | |
| 29 | US LONG BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 4.617.343,75 | (123.062,50) |
| 27 | US ULTRA BOND (CBT) 21/12/2021 | USD | 5.158.687,50 | (181.765,63) |
| | | | **9.776.031,25** | **(304.828,13)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **(114.555,68)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **38.095.431,28** | **95,51** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(114.555,68)** | **(0,29)** |
| **Bankguthaben** | **878.245,77** | **2,20** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **1.026.192,64** | **2,58** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **39.885.314,01** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US Growth Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 47.059.759,80 |
| | 30.09.2019 | USD | 53.125.024,30 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 28.683,20 |
| | 30.09.2019 | EUR | 24.078,42 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 22.561,64 |
| | 30.09.2019 | USD | 17.612,02 |
| Capitalisation I Hedged (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | - |
| | 30.09.2019 | EUR | 11.645,02 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 40,96 |
| | 30.09.2019 | EUR | 34,42 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 922,35 |
| | 30.09.2019 | USD | 727,15 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 357,87 |
| | 30.09.2019 | USD | 280,03 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 1.183,02 |
| | 30.09.2019 | EUR | 1.008,21 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | - |
| | 30.09.2020 | USD | 159,06 |
| | 30.09.2019 | USD | 126,10 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | - |
| | 30.09.2020 | EUR | 673,39 |
| | 30.09.2019 | EUR | 547,64 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | | - |
| | 30.09.2020 | | 21 |
| | 30.09.2019 | | 411 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | - |
| | 30.09.2020 | | 891 |
| | 30.09.2019 | | 1.413 |
| Capitalisation I Hedged (EUR) | 30.09.2021 | | - |
| | 30.09.2020 | | - |
| | 30.09.2019 | | 0,87 |

| | | |
|---|---|---|
| **Anzahl der Anteile** | | |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 399.027 |
| | 30.09.2019 | 312.452 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 3.952 |
| | 30.09.2019 | 4.715 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 332 |
| | 30.09.2019 | 142 |
| Capitalisation X (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 1.784 |
| | 30.09.2019 | 1.465 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 4.431 |
| | 30.09.2019 | 4.657 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | - |
| | 30.09.2020 | 179 |
| | 30.09.2019 | 99 |

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US Growth Equity

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für den Zeitraum vom 01.10.2020 bis 22.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **131.680,20** |
| Dividenden | | 131.680,20 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(342.821,03)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (259.007,84) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (74.088,68) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (19,18) |
| Abonnementsteuer | 9 | (9.426,83) |
| Bankzinsen | | (278,50) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **(211.140,83)** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 19.993.072,07 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (696.751,86) |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (2.186,65) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 111.606,65 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (141.649,89) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | (9.946.171,20) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 2.841,11 |
| **Ergebnis** | | **9.109.619,40** |
| Zeichnungen | | 6.662.344,16 |
| Rücknahmen | | (62.831.723,36) |
| Nettovermögen zu Beginn des Berichtszeitraums | | 47.059.759,80 |
| ***Nettovermögen am Ende des Berichtszeitraums*** | | - |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US High Dividend

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 309.957.646,98 |
| | 30.09.2020 | USD | 212.225.814,35 |
| | 30.09.2019 | USD | 250.642.693,50 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 14.696,66 |
| | 30.09.2020 | EUR | 11.376,79 |
| | 30.09.2019 | EUR | 12.685,79 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 821,09 |
| | 30.09.2020 | USD | 643,14 |
| | 30.09.2019 | USD | 666,77 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | PLN | 66.348,46 |
| | 30.09.2020 | PLN | 52.272,56 |
| | 30.09.2019 | PLN | 55.335,62 |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 669,95 |
| | 30.09.2020 | EUR | 516,77 |
| | 30.09.2019 | EUR | 574,20 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 606,55 |
| | 30.09.2020 | EUR | 474,21 |
| | 30.09.2019 | EUR | 534,08 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 697,57 |
| | 30.09.2020 | USD | 551,82 |
| | 30.09.2019 | USD | 577,78 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 596,76 |
| | 30.09.2020 | EUR | 477,30 |
| | 30.09.2019 | EUR | 511,87 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | USD | 327,11 |
| | 30.09.2020 | USD | 256,84 |
| | 30.09.2019 | USD | 266,90 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | USD | 643,26 |
| | 30.09.2020 | USD | 511,39 |
| | 30.09.2019 | USD | 538,11 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 513,45 |
| | 30.09.2020 | EUR | 413,11 |
| | 30.09.2019 | EUR | 446,53 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | USD | 403,91 |
| | 30.09.2020 | USD | 324,35 |
| | 30.09.2019 | USD | 344,75 |
| Distribution I (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.505,36 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.189,85 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.508,49 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 620,46 |
| | 30.09.2020 | EUR | 487,78 |
| | 30.09.2019 | EUR | 555,13 |
| Distribution N (USD) | 30.09.2021 | USD | 2.089,75 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.661,28 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.756,81 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 562,98 |
| | 30.09.2020 | EUR | 448,64 |
| | 30.09.2019 | EUR | 517,63 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | USD | 1.895,16 |
| | 30.09.2020 | USD | 1.527,28 |
| | 30.09.2019 | USD | 1.637,53 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | USD | 306,92 |
| | 30.09.2020 | USD | 245,47 |
| | 30.09.2019 | USD | 261,17 |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 345,95 |
| | 30.09.2020 | USD | 279,61 |
| | 30.09.2019 | USD | 299,90 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 324,58 |
| | 30.09.2020 | AUD | 264,84 |
| | 30.09.2019 | AUD | 292,56 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 4.349,46 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 3.503,32 |
| | 30.09.2019 | ZAR | 3.845,59 |
| Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | EUR | 354,75 |
| | 30.09.2020 | EUR | 290,09 |
| | 30.09.2019 | EUR | 320,22 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | USD | 316,71 |
| | 30.09.2020 | USD | 258,96 |
| | 30.09.2019 | USD | 280,93 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | AUD | 298,04 |
| | 30.09.2020 | AUD | 245,66 |
| | 30.09.2019 | AUD | 273,81 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | ZAR | 3.965,95 |
| | 30.09.2020 | ZAR | 3.238,68 |
| | 30.09.2019 | ZAR | 3.601,06 |

**Anzahl der Anteile**

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 340 |
| | 30.09.2020 | 619 |
| | 30.09.2019 | 1.475 |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 9.400 |
| | 30.09.2020 | 12.597 |
| | 30.09.2019 | 21.489 |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 1.644 |
| | 30.09.2020 | 1.469 |
| | 30.09.2019 | 1.498 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US High Dividend

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| Anzahl der Anteile | | |
|---|---|---|
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 82.506 |
| | 30.09.2020 | 92.633 |
| | 30.09.2019 | 90.069 |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 16.411 |
| | 30.09.2020 | 19.496 |
| | 30.09.2019 | 17.882 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 63.813 |
| | 30.09.2020 | 79.547 |
| | 30.09.2019 | 97.420 |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 56 |
| | 30.09.2020 | 56 |
| | 30.09.2019 | 333 |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 903 |
| | 30.09.2020 | 813 |
| | 30.09.2019 | 1.058 |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 30.630 |
| | 30.09.2020 | 21.689 |
| | 30.09.2019 | 19.529 |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 31 |
| | 30.09.2020 | 114 |
| | 30.09.2019 | 1.009 |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 96.558 |
| | 30.09.2020 | 17.816 |
| | 30.09.2019 | 11.153 |
| Distribution I (USD) | 30.09.2021 | 47 |
| | 30.09.2020 | 363 |
| | 30.09.2019 | 47 |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 15.843 |
| | 30.09.2020 | 19.392 |
| | 30.09.2019 | 31.307 |
| Distribution N (USD) | 30.09.2021 | 202 |
| | 30.09.2020 | 324 |
| | 30.09.2019 | 671 |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 101 |
| | 30.09.2020 | 186 |
| | 30.09.2019 | 224 |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 4.395 |
| | 30.09.2020 | 4.820 |
| | 30.09.2019 | 5.171 |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1.240 |
| | 30.09.2020 | 1.392 |
| | 30.09.2019 | 1.392 |

| Anzahl der Anteile | | |
|---|---|---|
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 24.434 |
| | 30.09.2020 | 22.739 |
| | 30.09.2019 | 33.750 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 18.034 |
| | 30.09.2020 | 15.325 |
| | 30.09.2019 | 13.684 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 27.162 |
| | 30.09.2020 | 26.677 |
| | 30.09.2019 | 20.942 |
| Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 754 |
| | 30.09.2020 | 1.153 |
| | 30.09.2019 | 967 |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 91.546 |
| | 30.09.2020 | 18.684 |
| | 30.09.2019 | 13.390 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 34.450 |
| | 30.09.2020 | 13.096 |
| | 30.09.2019 | 13.428 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 44.233 |
| | 30.09.2020 | 21.867 |
| | 30.09.2019 | 11.761 |

| Dividende | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution I (USD) | 14.12.2020 | USD | 105,50 |
| Distribution N (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 9,90 |
| Distribution N (USD) | 14.12.2020 | USD | 33,70 |
| Distribution P (EUR) | 14.12.2020 | EUR | 9,15 |
| Distribution P (USD) | 14.12.2020 | USD | 31,20 |
| Distribution R (USD) | 14.12.2020 | USD | 5,00 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 08.04.2021 | USD | 0,45 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US High Dividend

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution X (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) (USD) | 06.10.2020 | USD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 08.04.2021 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 06.10.2020 | AUD | 0,45 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 08.04.2021 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 06.10.2020 | ZAR | 17,20 |
| Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR) | 11.08.2021 | EUR | 1,50 |
| Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR) | 12.05.2021 | EUR | 1,50 |
| Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR) | 11.02.2021 | EUR | 1,40 |
| Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR) | 11.11.2020 | EUR | 1,20 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.09.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.08.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.07.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.06.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 04.05.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 08.04.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.03.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.02.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 05.01.2021 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 02.12.2020 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 03.11.2020 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) (USD) | 06.10.2020 | USD | 0,45 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.09.2021 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.08.2021 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.07.2021 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.06.2021 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 04.05.2021 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 08.04.2021 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.03.2021 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.02.2021 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 05.01.2021 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 02.12.2020 | AUD | 0,44 |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US High Dividend

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben (Fortsetzung)

| | | | |
|---|---|---|---|
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 03.11.2020 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 06.10.2020 | AUD | 0,44 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.09.2021 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.08.2021 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.07.2021 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.06.2021 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 04.05.2021 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 08.04.2021 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.03.2021 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.02.2021 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 05.01.2021 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 02.12.2020 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 03.11.2020 | ZAR | 16,90 |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 06.10.2020 | ZAR | 16,90 |

**Laufende Kosten in %***

| | | |
|---|---|---|
| Capitalisation I (EUR) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Capitalisation I Hedged (i) (PLN) | 30.09.2021 | 0,83% |
| Capitalisation N (EUR) | 30.09.2021 | 0,45% |
| Capitalisation P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Capitalisation P Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 1,82% |
| Capitalisation R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Capitalisation X (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Capitalisation X Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Capitalisation Y (USD) | 30.09.2021 | 3,30% |
| Distribution I (USD) | 30.09.2021 | 0,81% |
| Distribution N (EUR) | 30.09.2021 | 0,45% |
| Distribution N (USD) | 30.09.2021 | 0,45% |
| Distribution P (EUR) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution P (USD) | 30.09.2021 | 1,80% |
| Distribution R (USD) | 30.09.2021 | 1,05% |
| Distribution X (M) (USD) | 30.09.2021 | 2,30% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution X (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution X (Q) Hedged (i) (EUR) | 30.09.2021 | 2,32% |
| Distribution Y (M) (USD) | 30.09.2021 | 3,30% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (AUD) | 30.09.2021 | 3,32% |
| Distribution Y (M) Hedged (i) (ZAR) | 30.09.2021 | 3,32% |

| | | |
|---|---|---|
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | (65,86%) |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US High Dividend

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **303.000.388,80** |
| Aktien | | 303.000.388,80 |
| **Bankguthaben** | | **7.395.075,48** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4, 15 | **6.698.811,49** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***317.094.275,77*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4 | **(4.763.959,59)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **(2.372.669,20)** |
| Devisentermingeschäfte | | (2.372.669,20) |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(7.136.628,79)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***309.957.646,98*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **4.730.329,82** |
| Dividenden | | 4.724.894,60 |
| Sonstige Erträge | 10 | 5.435,22 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(4.517.811,12)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (3.177.273,10) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (1.203.701,27) |
| Overlay-Gebühren | 7 | (10.503,83) |
| Abonnementsteuer | 9 | (126.332,92) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **212.518,70** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 33.233.243,16 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (2.326.839,72) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 2.044.287,02 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (529.002,27) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 706.286,17 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (719.589,19) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 27.328.223,58 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | (1.116.683,48) |
| **Ergebnis** | | **58.832.443,97** |
| Zeichnungen | | 291.242.361,89 |
| Rücknahmen | | (250.621.647,35) |
| Ausschüttung | | (1.721.325,88) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 212.225.814,35 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***309.957.646,98*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US High Dividend

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Aktien** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 14.606 | ADVANCE AUTO PARTS INC | USD | 3.051.047,34 | 0,98 |
| 39.000 | AFLAC INC | USD | 2.033.070,00 | 0,66 |
| 17.825 | ALLSTATE CORP/THE | USD | 2.269.300,75 | 0,73 |
| 9.000 | AMERICAN TOWER CORP | USD | 2.388.690,00 | 0,77 |
| 11.722 | AMERIPRISE FINANCIAL INC | USD | 3.096.014,64 | 1,00 |
| 33.599 | APPLE INC | USD | 4.754.258,50 | 1,53 |
| 13.076 | APPLIED MATERIALS INC | USD | 1.683.273,48 | 0,54 |
| 45.406 | ATMOS ENERGY CORP | USD | 4.004.809,20 | 1,29 |
| 23.536 | AUTOMATIC DATA PROCESSING INC | USD | 4.705.317,12 | 1,52 |
| 154.361 | BAKER HUGHES CO - A | USD | 3.817.347,53 | 1,23 |
| 90.443 | BANK OF NEW YORK MELLON CORP/THE | USD | 4.688.565,12 | 1,51 |
| 33.682 | BECTON DICKINSON AND CO | USD | 8.279.709,24 | 2,67 |
| 871 | BLACKROCK INC - A | USD | 730.472,86 | 0,24 |
| 186.964 | CAPITOL FEDERAL FINANCIAL INC | USD | 2.148.216,36 | 0,69 |
| 43.334 | CARDINAL HEALTH INC | USD | 2.143.299,64 | 0,69 |
| 87.304 | CERNER CORP | USD | 6.156.678,08 | 1,99 |
| 94.609 | CHEVRON CORP | USD | 9.598.083,05 | 3,10 |
| 2.279 | CIGNA CORP | USD | 456.164,64 | 0,15 |
| 148.513 | CISCO SYSTEMS INC/DELAWARE | USD | 8.083.562,59 | 2,61 |
| 88.423 | COLGATE-PALMOLIVE CO | USD | 6.683.010,34 | 2,16 |
| 60.980 | CONAGRA BRANDS INC | USD | 2.065.392,60 | 0,67 |
| 168.424 | CORNING INC | USD | 6.145.791,76 | 1,98 |
| 26.728 | DUKE ENERGY HOLDING CORP COM | USD | 2.608.385,52 | 0,84 |
| 88.487 | EMERSON ELECTRIC CO | USD | 8.335.475,40 | 2,69 |
| 1.892 | EQUINIX INC | USD | 1.494.925,96 | 0,48 |
| 25.420 | EVERSOURCE ENERGY | USD | 2.078.339,20 | 0,67 |
| 19.452 | EXXON MOBIL CORP | USD | 1.144.166,64 | 0,37 |
| 24.171 | FREEPORT-MCMORAN INC | USD | 786.282,63 | 0,25 |
| 40.494 | HARTFORD FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 2.844.703,50 | 0,92 |
| 18.808 | HERSHEY CO/THE | USD | 3.183.254,00 | 1,03 |
| 28.306 | HUBBELL INC - B | USD | 5.114.045,02 | 1,65 |
| 96.415 | JOHNSON & JOHNSON | USD | 15.571.022,50 | 5,02 |
| 45.168 | JPMORGAN CHASE & CO | USD | 7.393.549,92 | 2,39 |
| 60.605 | MARSH & MCLENNAN COS INC | USD | 9.177.415,15 | 2,96 |
| 35.190 | MERCK & CO INC | USD | 2.643.120,90 | 0,85 |
| 9.997 | METLIFE INC | USD | 617.114,81 | 0,20 |
| 55.222 | MICROSOFT CORP | USD | 15.568.186,24 | 5,02 |
| 78.375 | MONDELEZ INTERNATIONAL INC - A | USD | 4.559.857,50 | 1,47 |
| 18.207 | NORFOLK SOUTHERN CORP | USD | 4.356.024,75 | 1,41 |
| 28.626 | NORTHERN TRUST CORP | USD | 3.086.169,06 | 1,00 |
| 89.995 | ONE GAS INC | USD | 5.702.983,15 | 1,84 |
| 53.494 | ORACLE CORP | USD | 4.660.932,22 | 1,50 |
| 13.360 | PACCAR INC | USD | 1.054.371,20 | 0,34 |
| 20.255 | PACKAGING CORP OF AMERICA | USD | 2.783.847,20 | 0,90 |
| 40.879 | PEPSICO INC | USD | 6.148.610,39 | 1,98 |
| 5.195 | PINNACLE WEST CAPITAL CORP | USD | 375.910,20 | 0,12 |
| 4.830 | PNC FINANCIAL SERVICES GROUP INC/THE | USD | 944.941,20 | 0,30 |
| 20.369 | PROCTER & GAMBLE CO/THE | USD | 2.847.586,20 | 0,92 |
| 17.228 | QUEST DIAGNOSTICS INC | USD | 2.503.400,68 | 0,81 |
| 66.574 | RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | USD | 5.722.701,04 | 1,85 |
| 32.377 | REINSURANCE GROUP OF AMERICA INC - A | USD | 3.602.265,02 | 1,16 |
| 38.358 | REPUBLIC SERVICES INC - A | USD | 4.605.261,48 | 1,49 |
| 76.589 | SPIRE INC | USD | 4.685.715,02 | 1,51 |
| 1.996 | T ROWE PRICE GROUP INC | USD | 392.613,20 | 0,13 |
| 35.579 | TEXAS INSTRUMENTS INC | USD | 6.838.639,59 | 2,21 |
| 11.067 | TRUIST FINANCIAL CORP | USD | 649.079,55 | 0,21 |
| 8.391 | UNITED PARCEL SERVICE INC - B | USD | 1.528.001,10 | 0,49 |
| 5.091 | UNITEDHEALTH GROUP INC | USD | 1.989.257,34 | 0,64 |
| 46.476 | US BANCORP | USD | 2.762.533,44 | 0,89 |
| 167.004 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | USD | 9.019.886,04 | 2,91 |
| 64.069 | WALMART INC | USD | 8.929.937,22 | 2,88 |
| 36.061 | WELLTOWER INC | USD | 2.971.426,40 | 0,96 |
| 9.529 | WW GRAINGER INC | USD | 3.745.468,74 | 1,21 |
| | | | **264.009.481,16** | **85,18** |
| **Irland** | | | | |
| 69.857 | JOHNSON CONTROLS INTERNATIONAL PLC | USD | 4.755.864,56 | 1,53 |
| 26.817 | LINDE PLC | USD | 7.867.571,46 | 2,54 |
| 113.098 | MEDTRONIC PLC | USD | 14.176.834,30 | 4,58 |
| 27.390 | PENTAIR PLC | USD | 1.989.335,70 | 0,64 |
| | | | **28.789.606,02** | **9,29** |
| **Schweiz** | | | | |
| 21.541 | CHUBB LTD | USD | 3.736.932,68 | 1,21 |
| 29.623 | TE CONNECTIVITY LTD | USD | 4.064.868,06 | 1,31 |
| | | | **7.801.800,74** | **2,52** |
| **Jersey** | | | | |
| 207.032 | AMCOR PLC | USD | 2.399.500,88 | 0,77 |
| | | | **2.399.500,88** | **0,77** |
| | | | **303.000.388,80** | **97,76** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **303.000.388,80** | **97,76** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | Zu zahlen | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | |
| 2.178.144,28 USD | 31.409.519,55 ZAR | 19/10/2021 | 2.178.144,28 | 94.880,13 |
| 391.934,32 USD | 532.363,09 AUD | 19/10/2021 | 391.934,32 | 7.357,27 |
| 169.767,58 USD | 669.609,87 PLN | 19/10/2021 | 169.767,58 | 1.156,98 |
| 1.760.169,77 ZAR | 115.972,32 USD | 04/10/2021 | 115.972,32 | 1.021,35 |
| 71.998,75 USD | 99.493,89 AUD | 01/10/2021 | 71.998,75 | 129,37 |
| 12.535,21 USD | 10.783,87 EUR | 19/10/2021 | 12.535,21 | 33,55 |
| 2.948,08 AUD | 2.119,23 USD | 05/10/2021 | 2.119,23 | 10,32 |
| 697,17 USD | 969,84 AUD | 05/10/2021 | 697,17 | (3,40) |
| 10.546,50 EUR | 12.250,29 USD | 04/10/2021 | 12.250,29 | (27,42) |
| 25.067,02 AUD | 18.139,75 USD | 01/10/2021 | 18.139,75 | (32,60) |
| 39.923,51 USD | 602.745,13 ZAR | 01/10/2021 | 39.923,51 | (139,31) |
| 334.448,49 EUR | 396.821,56 USD | 19/10/2021 | 396.821,56 | (9.097,90) |
| 17.199.364,95 AUD | 12.674.393,10 USD | 19/10/2021 | 12.674.393,10 | (249.637,94) |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US High Dividend

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeits-datum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 336.883.583,22 | ZAR | 23.299.960,78 | USD | 19/10/2021 | 23.299.960,78 | (955.859,22) |
| 111.518.503,02 | PLN | 29.343.292,32 | USD | 19/10/2021 | 29.343.292,32 | (1.262.460,38) |
| | | | | | **68.727.950,17** | **(2.372.669,20)** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | | | **(2.372.669,20)** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **303.000.388,80** | **97,76** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **(2.372.669,20)** | **(0,77)** |
| **Bankguthaben** | **7.395.075,48** | **2,39** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **1.934.851,90** | **0,62** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **309.957.646,98** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Statistische Angaben

| | | | |
|---|---|---|---|
| **Nettovermögen** | 30.09.2021 | USD | 282.153.556,75 |
| | 30.09.2020 | USD | 268.580.272,80 |
| | 30.09.2019 | USD | 233.889.449,29 |
| **Nettoinventarwert pro Anteil**** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.314,56 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.613,99 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.487,49 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | USD | 310,86 |
| | 30.09.2020 | USD | 277,44 |
| | 30.09.2019 | USD | 272,32 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | USD | 6.489,52 |
| | 30.09.2020 | USD | 5.728,17 |
| | 30.09.2019 | USD | 5.558,91 |
| Capitalisation Zz (USD) | 30.09.2021 | USD | 318.274,90 |
| | 30.09.2020 | USD | 280.513,90 |
| | 30.09.2019 | USD | 271.816,36 |
| **Anzahl der Anteile** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 17.066 |
| | 30.09.2020 | | 23.112 |
| | 30.09.2019 | | 15.687 |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 9 |
| | 30.09.2020 | | 32 |
| | 30.09.2019 | | 32 |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | | 25.940 |
| | 30.09.2020 | | 23.304 |
| | 30.09.2019 | | 25.120 |
| Capitalisation Zz (USD) | 30.09.2021 | | 19 |
| | 30.09.2020 | | 19 |
| | 30.09.2019 | | 30 |
| **Laufende Kosten in %*** | | | |
| Capitalisation I (USD) | 30.09.2021 | | 0,88% |
| Capitalisation P (USD) | 30.09.2021 | | 1,27% |
| Capitalisation Z (USD) | 30.09.2021 | | 0,16% |
| Capitalisation Zz (USD) | 30.09.2021 | | 0,01% |
| **Portfolioumsatz in %*** | 30.09.2021 | | 111,86% |

* Der Portfolioumsatz wird von der Verwaltungsstelle ermittelt (siehe Note 17).
Der Betrag der laufenden Kosten entspricht dem Betrag, der in den zum Zeitpunkt dieses Berichts aktuellen Wesentlichen Anlegerinformationen (KIID) als laufende Kosten ausgewiesen wird.
Etwaige Transaktionskosten sind im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten. Diese Kosten, die nicht als betriebliche Aufwendungen behandelt werden, sind in der Berechnung der laufenden Kosten nicht enthalten.
Die laufenden Kosten und der Portfolioumsatz werden für die letzten zwölf Monate ermittelt.
Die laufenden Kosten werden bei Zeiträumen unter einem Jahr annualisiert. Der Portfolioumsatz wird bei Zeiträumen unter einem Jahr nicht annualisiert.

**Offizieller Nettoinventarwert je Anteil, ggf. einschließlich Swing-Pricing-Anpassung.

# NN (L) US High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Finanzabschlüsse

### Nettovermögensaufstellung zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | 2 | **272.263.481,93** |
| Anleihen und andere Schuldtitel | | 272.263.481,93 |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | 2 | **273.168,60** |
| Devisentermingeschäfte | | 186.316,89 |
| Futures | | 86.851,71 |
| **Bankguthaben** | | **6.310.592,91** |
| **Hinterlegte Sicherheiten** | | **109.905,15** |
| **Sonstige Vermögenswerte** | 4 | **8.373.889,74** |
| ***Vermögenswerte Gesamt*** | | ***287.331.038,33*** |
| **Sonstige Verbindlichkeiten** | 4, 15 | **(5.177.481,58)** |
| ***Verbindlichkeiten Gesamt*** | | ***(5.177.481,58)*** |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***282.153.556,75*** |

### Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens für das Jahr zum 30.09.2021

| | Erläuterungen | |
|---|---|---|
| **Gesamterträge** | 2 | **16.456.203,24** |
| Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln | | 16.369.803,41 |
| Sonstige Erträge | 10 | 86.399,83 |
| **Gesamtaufwendungen** | | **(1.354.679,84)** |
| Verwaltungsgebühren | 5 | (889.330,03) |
| Feste Servicegebühr | 6 | (429.502,56) |
| Abonnementsteuer | 9 | (29.768,97) |
| Bankzinsen | | (6.078,28) |
| **Nettoergebnis der Anlagen** | | **15.101.523,40** |
| Realisierter Gewinn aus dem Anlageportfolio | 2 | 11.770.935,35 |
| Realisierter Verlust aus dem Anlageportfolio | 2 | (1.574.917,11) |
| Realisierter Gewinn aus derivativen Finanzinstrumenten | | 3.272.163,70 |
| Realisierter Verlust aus derivativen Finanzinstrumenten | | (3.438.446,02) |
| Realisierter Gewinn aus Devisengeschäften | | 188.967,50 |
| Realisierter Verlust aus Devisengeschäften | | (232.933,19) |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus dem Anlageportfolio | | 9.419.125,23 |
| Veränderung des nicht realisierten Nettogewinns oder -verlusts aus derivativen Finanzinstrumenten | | 474.140,61 |
| **Ergebnis** | | **34.980.559,47** |
| Zeichnungen | | 31.910.185,13 |
| Rücknahmen | | (53.317.460,65) |
| Nettovermögen zu Beginn des Jahres | | 268.580.272,80 |
| ***Nettovermögen am Ende des Jahres*** | | ***282.153.556,75*** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| **Zu einer amtlichen Börsennotierung zugelassene und/oder an einem anderen geregelten Markt gehandelte übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente** | | | | |
| **Anleihen und andere Schuldtitel** | | | | |
| **Vereinigte Staaten** | | | | |
| 2.025.000 | ACRISURE LLC / ACRISURE FINANCE INC 7.000% 15/11/2025 | USD | 2.064.078,81 | 0,73 |
| 1.515.000 | ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 4.625% 15/01/2027 | USD | 1.589.638,70 | 0,56 |
| 730.000 | ALBERTSONS COS INC / SAFEWAY INC / NEW ALBERTSONS LP / ALBERTSONS LLC 5.875% 15/02/2028 | USD | 777.193,94 | 0,28 |
| 200.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.000% 01/06/2029 | USD | 197.592,94 | 0,07 |
| 1.749.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC / ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026 | USD | 1.850.534,14 | 0,66 |
| 2.688.000 | AMERICAN AIRLINES INC 11.750% 15/07/2025 | USD | 3.325.180,94 | 1,19 |
| 2.075.000 | AMERICAN AXLE & MANUFACTURING INC 5.000% 01/10/2029 | USD | 2.021.945,47 | 0,72 |
| 1.460.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 01/03/2027 | USD | 1.509.011,40 | 0,53 |
| 1.337.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 5.750% 15/01/2028 | USD | 1.385.479,77 | 0,49 |
| 680.000 | ANTERO MIDSTREAM PARTNERS LP / ANTERO MIDSTREAM FINANCE CORP 7.875% 15/05/2026 | USD | 744.306,51 | 0,26 |
| 517.000 | ANTERO RESOURCES CORP 7.625% 01/02/2029 | USD | 577.728,33 | 0,20 |
| 1.750.000 | APEX TOOL GROUP LLC / BC MOUNTAIN FINANCE INC 9.000% 15/02/2023 | USD | 1.754.250,05 | 0,62 |
| 1.500.000 | ARCHES BUYER INC 4.250% 01/06/2028 | USD | 1.521.189,95 | 0,54 |
| 150.000 | ARCHES BUYER INC 6.125% 01/12/2028 | USD | 152.862,24 | 0,05 |
| 950.000 | ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.250% 01/04/2028 | USD | 981.300,75 | 0,35 |
| 915.000 | ARCHROCK PARTNERS LP / ARCHROCK PARTNERS FINANCE CORP 6.875% 01/04/2027 | USD | 959.079,11 | 0,34 |
| 2.445.000 | ARROW BIDCO LLC 9.500% 15/03/2024 | USD | 2.507.788,04 | 0,89 |
| 1.075.000 | ASHLAND LLC 3.375% 01/09/2031 | USD | 1.087.220,06 | 0,39 |
| 1.640.000 | AUDACY CAPITAL CORP 6.750% 31/03/2029 | USD | 1.653.414,87 | 0,59 |
| 1.250.000 | BAUSCH HEALTH AMERICAS INC 8.500% 31/01/2027 | USD | 1.333.273,24 | 0,47 |
| 2.018.000 | BCPE ULYSSES INTERMEDIATE INC 7.750% 01/04/2027 | USD | 2.011.417,87 | 0,71 |
| 1.405.000 | BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 6.625% 15/07/2026 | USD | 1.464.718,09 | 0,52 |
| 500.000 | BLUE RACER MIDSTREAM LLC / BLUE RACER FINANCE CORP 7.625% 15/12/2025 | USD | 540.510,41 | 0,19 |
| 545.000 | BROADSTREET PARTNERS INC 5.875% 15/04/2029 | USD | 543.032,74 | 0,19 |
| 1.628.000 | BUILDERS FIRSTSOURCE INC 4.250% 01/02/2032 | USD | 1.665.399,51 | 0,59 |
| 1.000.000 | CALLON PETROLEUM CO 6.375% 01/07/2026 | USD | 956.039,89 | 0,34 |
| 1.707.000 | CALLON PETROLEUM CO 8.000% 01/08/2028 | USD | 1.685.522,95 | 0,60 |
| 2.186.000 | CARGO AIRCRAFT MANAGEMENT INC 4.750% 01/02/2028 | USD | 2.260.028,91 | 0,80 |
| 1.515.000 | CARRIAGE SERVICES INC 4.250% 15/05/2029 | USD | 1.528.994,18 | 0,54 |
| 652.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.250% 15/01/2034 | USD | 647.844,36 | 0,23 |
| 130.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 01/05/2032 | USD | 133.885,98 | 0,05 |
| 755.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.500% 15/08/2030 | USD | 778.100,69 | 0,28 |
| 1.115.000 | CCO HOLDINGS LLC / CCO HOLDINGS CAPITAL CORP 4.750% 01/03/2030 | USD | 1.165.569,74 | 0,41 |
| 476.000 | CENTENE CORP 2.450% 15/07/2028 | USD | 478.300,78 | 0,17 |
| 1.547.000 | CENTENE CORP 2.500% 01/03/2031 | USD | 1.524.724,48 | 0,54 |
| 1.110.000 | CENTENE CORP 3.375% 15/02/2030 | USD | 1.148.898,61 | 0,41 |
| 1.250.000 | CENTENE CORP 4.250% 15/12/2027 | USD | 1.308.199,11 | 0,46 |
| 1.286.000 | CENTENNIAL RESOURCE PRODUCTION LLC 6.875% 01/04/2027 | USD | 1.310.113,23 | 0,46 |
| 305.000 | CHEMOURS CO/THE 4.000% 15/05/2026 | EUR | 360.549,34 | 0,13 |
| 1.295.000 | CHEMOURS CO/THE 4.625% 15/11/2029 | USD | 1.264.781,85 | 0,45 |
| 117.000 | CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 3.250% 31/01/2032 | USD | 117.441,62 | 0,04 |
| 2.535.000 | CHENIERE ENERGY PARTNERS LP 4.500% 01/10/2029 | USD | 2.696.732,01 | 0,96 |
| 2.744.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 5.625% 15/03/2027 | USD | 2.875.364,69 | 1,03 |
| 143.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.000% 15/01/2029 | USD | 151.568,12 | 0,05 |
| 50.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.125% 01/04/2030 | USD | 48.538,33 | 0,02 |
| 418.000 | CHS/COMMUNITY HEALTH SYSTEMS INC 6.625% 15/02/2025 | USD | 437.500,20 | 0,16 |
| 1.557.000 | CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 3.875% 01/07/2028 | USD | 1.557.239,39 | 0,55 |
| 286.000 | CLARIVATE SCIENCE HOLDINGS CORP 4.875% 01/07/2029 | USD | 286.556,96 | 0,10 |
| 75.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 3.750% 15/01/2032 | USD | 75.138,72 | 0,03 |
| 2.190.000 | CLEARWAY ENERGY OPERATING LLC 4.750% 15/03/2028 | USD | 2.317.049,87 | 0,82 |
| 500.000 | CLEVELAND-CLIFFS INC 4.875% 01/03/2031 | USD | 516.284,80 | 0,18 |
| 1.750.000 | CLEVELAND-CLIFFS INC 5.875% 01/06/2027 | USD | 1.815.553,25 | 0,64 |
| 788.000 | CNX MIDSTREAM PARTNERS LP / CNX MIDSTREAM FINANCE CORP 6.500% 15/03/2026 | USD | 827.692,48 | 0,29 |
| 997.000 | COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC 5.875% 01/07/2029 | USD | 1.007.711,69 | 0,36 |
| 1.586.000 | COLGATE ENERGY PARTNERS III LLC 7.750% 15/02/2026 | USD | 1.676.121,90 | 0,59 |
| 500.000 | COMSTOCK RESOURCES INC 5.875% 15/01/2030 | USD | 520.069,25 | 0,18 |
| 1.257.000 | COMSTOCK RESOURCES INC 6.750% 01/03/2029 | USD | 1.358.417,44 | 0,48 |
| 375.000 | CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC 6.000% 15/10/2026 | USD | 385.604,00 | 0,14 |
| 375.000 | CONSENSUS CLOUD SOLUTIONS INC 6.500% 15/10/2028 | USD | 389.011,19 | 0,14 |
| 1.029.000 | CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 5.000% 01/10/2028 | USD | 1.062.020,91 | 0,38 |
| 481.000 | CONSOLIDATED COMMUNICATIONS INC 6.500% 01/10/2028 | USD | 524.354,81 | 0,19 |
| 1.234.000 | COOPER-STANDARD AUTOMOTIVE INC 13.000% 01/06/2024 | USD | 1.355.831,68 | 0,48 |
| 1.575.000 | COTY INC 6.500% 15/04/2026 | USD | 1.614.143,38 | 0,57 |
| 1.165.000 | CSC HOLDINGS LLC 4.125% 01/12/2030 | USD | 1.141.928,51 | 0,40 |
| 700.000 | CSC HOLDINGS LLC 4.625% 01/12/2030 | USD | 663.554,85 | 0,24 |
| 100.000 | ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.500% 30/01/2026 | USD | 104.212,47 | 0,04 |
| 1.878.000 | ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 5.750% 30/01/2028 | USD | 1.977.381,81 | 0,70 |
| 125.000 | ENDEAVOR ENERGY RESOURCES LP / EER FINANCE INC 6.625% 15/07/2025 | USD | 132.078,74 | 0,05 |
| 1.185.000 | ENLINK MIDSTREAM PARTNERS LP 4.150% 01/06/2025 | USD | 1.222.300,94 | 0,43 |
| 150.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.500% 15/01/2029 | USD | 155.812,29 | 0,06 |
| 150.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 4.750% 15/01/2031 | USD | 156.001,62 | 0,06 |
| 2.102.000 | EQM MIDSTREAM PARTNERS LP 5.500% 15/07/2028 | USD | 2.312.024,36 | 0,82 |
| 1.200.000 | FORD MOTOR CO 7.450% 16/07/2031 | USD | 1.565.203,88 | 0,55 |
| 160.000 | FORD MOTOR CO 9.625% 22/04/2030 | USD | 226.916,17 | 0,08 |
| 1.200.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 1.355% 07/02/2025 EMTN | EUR | 1.382.109,20 | 0,49 |
| 600.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 2.900% 16/02/2028 | USD | 595.940,70 | 0,21 |
| 339.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.000% 13/11/2030 | USD | 352.524,84 | 0,12 |
| 570.000 | FORD MOTOR CREDIT CO LLC 4.125% 17/08/2027 | USD | 604.653,64 | 0,21 |
| 1.050.000 | FXI HOLDINGS INC 12.250% 15/11/2026 | USD | 1.189.224,61 | 0,42 |
| 1.229.000 | FXI HOLDINGS INC 7.875% 01/11/2024 | USD | 1.254.924,49 | 0,44 |
| 200.000 | GAP INC/THE 3.625% 01/10/2029 | USD | 200.481,26 | 0,07 |
| 300.000 | GAP INC/THE 3.875% 01/10/2031 | USD | 300.027,93 | 0,11 |
| 1.200.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.375% 15/06/2026 | USD | 1.217.720,23 | 0,43 |
| 350.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 3.750% 15/09/2030 | USD | 355.010,33 | 0,13 |
| 450.000 | HAT HOLDINGS I LLC / HAT HOLDINGS II LLC 6.000% 15/04/2025 | USD | 470.922,49 | 0,17 |
| 3.075.000 | HCA INC 3.500% 01/09/2030 | USD | 3.257.432,95 | 1,16 |
| 1.525.000 | HUGHES SATELLITE SYSTEMS CORP 5.250% 01/08/2026 | USD | 1.718.166,70 | 0,61 |
| 740.000 | IHEARTCOMMUNICATIONS INC 5.250% 15/08/2027 | USD | 769.584,08 | 0,27 |
| 1.325.000 | IHEARTCOMMUNICATIONS INC 8.375% 01/05/2027 | USD | 1.415.440,87 | 0,50 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeich-nung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.083.000 | IMOLA MERGER CORP 4.750% 15/05/2029 | USD | 2.156.095,49 | 0,76 |
| 1.618.000 | INGLES MARKETS INC 4.000% 15/06/2031 | USD | 1.641.313,37 | 0,58 |
| 1.325.000 | INNOPHOS HOLDINGS INC 9.375% 15/02/2028 | USD | 1.432.319,89 | 0,51 |
| 1.273.000 | IQVIA INC 2.250% 15/01/2028 | EUR | 1.484.286,80 | 0,53 |
| 1.542.000 | JEFFERIES FINANCE LLC / JFIN CO-ISSUER CORP 5.000% 15/08/2028 | USD | 1.563.788,46 | 0,55 |
| 1.634.000 | KB HOME 4.000% 15/06/2031 | USD | 1.676.584,31 | 0,59 |
| 2.250.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 4.375% 01/06/2046 | USD | 2.567.232,07 | 0,91 |
| 200.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 4.875% 01/10/2049 | USD | 243.538,64 | 0,09 |
| 525.000 | KRAFT HEINZ FOODS CO 5.000% 15/07/2035 | USD | 646.196,29 | 0,23 |
| 1.729.000 | KRATON POLYMERS LLC / KRATON POLYMERS CAPITAL CORP 4.250% 15/12/2025 | USD | 1.803.096,19 | 0,64 |
| 1.342.000 | KRATON POLYMERS LLC / KRATON POLYMERS CAPITAL CORP 5.250% 15/05/2026 | EUR | 1.600.685,10 | 0,57 |
| 1.835.000 | LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLP / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 4.250% 01/02/2027 | USD | 1.824.738,64 | 0,65 |
| 269.000 | LADDER CAPITAL FINANCE HOLDINGS LLLP / LADDER CAPITAL FINANCE CORP 4.750% 15/06/2029 | USD | 267.516,48 | 0,09 |
| 2.330.000 | LAREDO PETROLEUM INC 7.750% 31/07/2029 | USD | 2.334.458,94 | 0,83 |
| 1.705.000 | LOGMEIN INC 5.500% 01/09/2027 | USD | 1.731.457,95 | 0,61 |
| 1.912.000 | LPL HOLDINGS INC 4.000% 15/03/2029 | USD | 1.964.791,12 | 0,70 |
| 572.000 | MAJORDRIVE HOLDINGS IV LLC 6.375% 01/06/2029 | USD | 553.024,37 | 0,20 |
| 1.375.000 | MATADOR RESOURCES CO 5.875% 15/09/2026 | USD | 1.418.700,13 | 0,50 |
| 1.400.000 | MATTEL INC 3.750% 01/04/2029 | USD | 1.459.584,55 | 0,52 |
| 230.000 | MATTEL INC 6.200% 01/10/2040 | USD | 295.718,98 | 0,10 |
| 1.011.000 | MAV ACQUISITION CORP 5.750% 01/08/2028 | USD | 992.525,24 | 0,35 |
| 1.000.000 | MAV ACQUISITION CORP 8.000% 01/08/2029 | USD | 954.760,75 | 0,34 |
| 2.000.000 | MICHAELS COS INC/THE 7.875% 01/05/2029 | USD | 2.074.030,16 | 0,74 |
| 241.000 | MIDCAP FINANCIAL ISSUER TRUST 5.625% 15/01/2030 | USD | 238.864,27 | 0,08 |
| 599.000 | MIDCAP FINANCIAL ISSUER TRUST 6.500% 01/05/2028 | USD | 625.770,68 | 0,22 |
| 1.633.000 | MILLENNIUM ESCROW CORP 6.625% 01/08/2026 | USD | 1.680.638,68 | 0,60 |
| 1.720.000 | NATIONSTAR MORTGAGE HOLDINGS INC 5.500% 15/08/2028 | USD | 1.771.260,04 | 0,63 |
| 1.094.000 | NESCO HOLDINGS II INC 5.500% 15/04/2029 | USD | 1.135.342,18 | 0,40 |
| 734.000 | NETFLIX INC 3.875% 15/11/2029 | EUR | 1.028.652,34 | 0,36 |
| 500.000 | NETFLIX INC 4.875% 15/04/2028 | USD | 575.513,92 | 0,20 |
| 373.000 | NEW ENTERPRISE STONE & LIME CO INC 5.250% 15/07/2028 | USD | 377.365,57 | 0,13 |
| 1.867.000 | NEXSTAR MEDIA INC 5.625% 15/07/2027 | USD | 1.977.457,13 | 0,70 |
| 2.339.000 | NFP CORP 6.875% 15/08/2028 | USD | 2.387.300,21 | 0,85 |
| 1.410.000 | NMI HOLDINGS INC 7.375% 01/06/2025 | USD | 1.609.002,63 | 0,57 |
| 881.000 | NOKIA OF AMERICA CORP 6.450% 15/03/2029 | USD | 994.749,68 | 0,35 |
| 2.107.000 | NORTHERN OIL AND GAS INC 8.125% 01/03/2028 | USD | 2.261.170,75 | 0,80 |
| 1.586.000 | NUSTAR LOGISTICS LP 6.000% 01/06/2026 | USD | 1.720.580,62 | 0,61 |
| 1.550.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.200% 15/08/2026 | USD | 1.582.147,90 | 0,56 |
| 2.000.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.400% 15/04/2026 | USD | 2.052.974,92 | 0,73 |
| 1.000.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 3.500% 15/08/2029 | USD | 1.016.903,86 | 0,36 |
| 775.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 4.400% 15/04/2046 | USD | 771.082,69 | 0,27 |
| 625.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 6.125% 01/01/2031 | USD | 748.917,29 | 0,27 |
| 415.000 | OCCIDENTAL PETROLEUM CORP 8.875% 15/07/2030 | USD | 563.790,34 | 0,20 |
| 1.130.000 | OLIN CORP 5.625% 01/08/2029 | USD | 1.235.682,36 | 0,44 |
| 182.000 | OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 3.875% 01/10/2028 | EUR | 211.247,57 | 0,07 |
| 244.000 | OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 4.250% 01/10/2028 | USD | 241.205,13 | 0,09 |
| 233.000 | OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 5.375% 01/10/2029 | EUR | 267.173,76 | 0,09 |
| 233.000 | OLYMPUS WATER US HOLDING CORP 6.250% 01/10/2029 | USD | 231.251,34 | 0,08 |
| 100.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 6.625% 15/01/2028 | USD | 114.716,98 | 0,04 |
| 915.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 6.875% 15/03/2025 | USD | 1.028.033,50 | 0,36 |
| 1.380.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 7.125% 15/03/2026 | USD | 1.595.972,70 | 0,57 |
| 255.000 | ONEMAIN FINANCE CORP 8.875% 01/06/2025 | USD | 276.385,59 | 0,10 |
| 1.364.000 | PARK RIVER HOLDINGS INC 5.625% 01/02/2029 | USD | 1.320.402,54 | 0,47 |
| 1.750.000 | PITNEY BOWES INC 6.875% 15/03/2027 | USD | 1.847.412,21 | 0,65 |
| 1.000.000 | PRA GROUP INC 5.000% 01/10/2029 | USD | 1.002.508,44 | 0,36 |
| 1.335.000 | PRA GROUP INC 7.375% 01/09/2025 | USD | 1.425.767,94 | 0,51 |
| 1.300.000 | PRIMO WATER HOLDINGS INC 3.875% 31/10/2028 | EUR | 1.561.929,31 | 0,55 |
| 460.000 | RADIAN GROUP INC 4.875% 15/03/2027 | USD | 501.834,60 | 0,18 |
| 685.000 | RADIAN GROUP INC 6.625% 15/03/2025 | USD | 765.829,02 | 0,27 |
| 1.265.000 | RANGE RESOURCES CORP 8.250% 15/01/2029 | USD | 1.423.108,71 | 0,50 |
| 738.000 | RANGE RESOURCES CORP 9.250% 01/02/2026 | USD | 804.710,41 | 0,29 |
| 1.439.000 | REAL HERO MERGER SUB 2 INC 6.250% 01/02/2029 | USD | 1.492.699,32 | 0,53 |
| 254.000 | ROCKCLIFF ENERGY II LLC 5.500% 15/10/2029 | USD | 257.835,84 | 0,09 |
| 1.831.000 | ROCKET SOFTWARE INC 6.500% 15/02/2029 | USD | 1.810.972,43 | 0,64 |
| 500.000 | SCRIPPS ESCROW II INC 3.875% 15/01/2029 | USD | 501.621,13 | 0,18 |
| 400.000 | SCRIPPS ESCROW II INC 5.375% 15/01/2031 | USD | 393.268,58 | 0,14 |
| 963.000 | SCRIPPS ESCROW INC 5.875% 15/07/2027 | USD | 987.043,64 | 0,35 |
| 310.000 | SENSATA TECHNOLOGIES INC 3.750% 15/02/2031 | USD | 312.036,48 | 0,11 |
| 1.120.000 | SENSATA TECHNOLOGIES INC 4.375% 15/02/2030 | USD | 1.204.586,23 | 0,43 |
| 260.000 | SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 3.375% 15/08/2030 | USD | 259.833,19 | 0,09 |
| 1.000.000 | SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 4.000% 15/05/2031 | USD | 1.034.385,38 | 0,37 |
| 620.000 | SERVICE CORP INTERNATIONAL/US 5.125% 01/06/2029 | USD | 674.307,77 | 0,24 |
| 1.795.000 | SIGNAL PARENT INC 6.125% 01/04/2029 | USD | 1.723.154,96 | 0,61 |
| 1.500.000 | SINCLAIR TELEVISION GROUP INC 5.125% 15/02/2027 | USD | 1.493.382,29 | 0,53 |
| 288.000 | SIRIUS XM RADIO INC 3.125% 01/09/2026 | USD | 291.913,43 | 0,10 |
| 767.000 | SIRIUS XM RADIO INC 3.875% 01/09/2031 | USD | 749.444,74 | 0,27 |
| 840.000 | SIRIUS XM RADIO INC 4.000% 15/07/2028 | USD | 854.880,85 | 0,30 |
| 1.645.000 | SIRIUS XM RADIO INC 4.125% 01/07/2030 | USD | 1.653.556,47 | 0,59 |
| 2.047.000 | SIZZLING PLATTER LLC / SIZZLING PLATTER FINANCE CORP 8.500% 28/11/2025 | USD | 2.113.246,94 | 0,75 |
| 1.465.000 | SPRINT CAPITAL CORP 6.875% 15/11/2028 | USD | 1.871.140,56 | 0,66 |
| 375.000 | SPRINT CAPITAL CORP 8.750% 15/03/2032 | USD | 560.527,83 | 0,20 |
| 1.935.000 | SRM ESCROW ISSUER LLC 6.000% 01/11/2028 | USD | 2.050.985,51 | 0,73 |
| 895.000 | STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 3.375% 15/01/2031 | USD | 851.716,22 | 0,30 |
| 334.000 | STANDARD INDUSTRIES INC/NJ 4.750% 15/01/2028 | USD | 348.009,55 | 0,12 |
| 1.733.000 | STAPLES INC 10.750% 15/04/2027 | USD | 1.686.171,83 | 0,60 |
| 1.543.000 | STAPLES INC 7.500% 15/04/2026 | USD | 1.564.807,05 | 0,55 |
| 1.875.000 | STARWOOD PROPERTY TRUST INC 5.500% 01/11/2023 | USD | 1.968.473,01 | 0,70 |
| 2.103.000 | STONEX GROUP INC 8.625% 15/06/2025 | USD | 2.263.275,29 | 0,80 |
| 211.000 | SUMMER BC BIDCO B LLC 5.500% 31/10/2026 | USD | 216.383,41 | 0,08 |
| 1.718.000 | SUNCOKE ENERGY INC 4.875% 30/06/2029 | USD | 1.711.199,00 | 0,61 |
| 1.200.000 | SWF ESCROW ISSUER CORP 6.500% 01/10/2029 | USD | 1.166.567,39 | 0,41 |
| 1.000.000 | TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 6.000% 01/03/2027 | USD | 1.045.961,70 | 0,37 |
| 860.000 | TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 6.000% 31/12/2030 | USD | 881.378,76 | 0,31 |
| 1.230.000 | TALLGRASS ENERGY PARTNERS LP / TALLGRASS ENERGY FINANCE CORP 7.500% 01/10/2025 | USD | 1.330.583,16 | 0,47 |
| 816.000 | TAP ROCK RESOURCES LLC 7.000% 01/10/2026 | USD | 835.433,48 | 0,30 |
| 375.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.000% 15/01/2032 | USD | 387.458,66 | 0,14 |
| 640.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 4.875% 01/02/2031 | USD | 690.326,57 | 0,24 |
| 596.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.375% 01/02/2027 | USD | 617.034,38 | 0,22 |
| 1.000.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 5.500% 01/03/2030 | USD | 1.093.676,30 | 0,39 |
| 65.000 | TARGA RESOURCES PARTNERS LP / TARGA RESOURCES PARTNERS FINANCE CORP 6.500% 15/07/2027 | USD | 70.077,62 | 0,02 |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Wertpapierbestand zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl/ Nominal | Bezeichnung | Währung | Marktwert in USD | % NIW |
|---|---|---|---|---|
| 2.672.000 | TENET HEALTHCARE CORP 4.250% 01/06/2029 | USD | 2.713.815,14 | 0,96 |
| 132.000 | TENET HEALTHCARE CORP 4.625% 15/07/2024 | USD | 134.159,46 | 0,05 |
| 175.000 | TENET HEALTHCARE CORP 6.250% 01/02/2027 | USD | 181.889,57 | 0,06 |
| 310.000 | T-MOBILE USA INC 2.550% 15/02/2031 | USD | 311.293,53 | 0,11 |
| 724.000 | T-MOBILE USA INC 2.625% 15/02/2029 | USD | 731.303,34 | 0,26 |
| 310.000 | T-MOBILE USA INC 2.875% 15/02/2031 | USD | 312.776,88 | 0,11 |
| 1.000.000 | T-MOBILE USA INC 3.500% 15/04/2031 | USD | 1.055.420,08 | 0,37 |
| 1.150.000 | T-MOBILE USA INC 4.750% 01/02/2028 | USD | 1.220.931,95 | 0,43 |
| 1.532.000 | TTM TECHNOLOGIES INC 4.000% 01/03/2029 | USD | 1.525.418,25 | 0,54 |
| 253.000 | UNITED RENTALS NORTH AMERICA INC 3.750% 15/01/2032 | USD | 255.964,12 | 0,09 |
| 2.794.000 | UNITI GROUP LP / UNITI GROUP FINANCE INC / CSL CAPITAL LLC 6.500% 15/02/2029 | USD | 2.874.289,98 | 1,03 |
| 2.115.000 | UNIVISION COMMUNICATIONS INC 4.500% 01/05/2029 | USD | 2.153.676,01 | 0,76 |
| 1.889.000 | VICTORIA'S SECRET & CO 4.625% 15/07/2029 | USD | 1.919.977,41 | 0,68 |
| 1.250.000 | WESTERN MIDSTREAM OPERATING LP 4.500% 01/03/2028 | USD | 1.352.016,58 | 0,48 |
| 1.536.000 | WHITE CAP PARENT LLC 8.250% 15/03/2026 | USD | 1.585.846,20 | 0,56 |
| 700.000 | WOLVERINE ESCROW LLC 13.125% 15/11/2027 | USD | 460.427,07 | 0,16 |
| 1.165.000 | WORLD ACCEPTANCE CORP 7.000% 01/11/2026 | USD | 1.149.863,35 | 0,41 |
| 214.000 | WR GRACE HOLDINGS LLC 5.625% 15/08/2029 | USD | 220.842,28 | 0,08 |
| 1.619.000 | W&T OFFSHORE INC 9.750% 01/11/2023 | USD | 1.537.601,26 | 0,54 |
| | | | **235.505.199,77** | **83,47** |
| | **Kanada** | | | |
| 194.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 4.875% 01/06/2028 | USD | 201.166,03 | 0,07 |
| 1.050.000 | BAUSCH HEALTH COS INC 6.125% 15/04/2025 | USD | 1.072.477,96 | 0,38 |
| 252.000 | CLARIOS GLOBAL LP 6.750% 15/05/2025 | USD | 266.711,40 | 0,09 |
| 1.500.000 | GARDA WORLD SECURITY CORP 9.500% 01/11/2027 | USD | 1.620.543,65 | 0,57 |
| 2.430.000 | HUSKY III HOLDING LTD 13.000% 15/02/2025 | USD | 2.582.275,34 | 0,93 |
| | | | **5.743.174,38** | **2,04** |
| | **Vereinigtes Königreich** | | | |
| 913.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 1 PLC 3.750% 15/07/2026 | EUR | 1.087.573,47 | 0,39 |
| 348.000 | INEOS QUATTRO FINANCE 2 PLC 3.375% 15/01/2026 | USD | 351.642,84 | 0,12 |
| 575.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 6.500% 15/02/2023 | EUR | 678.027,94 | 0,24 |
| 2.175.000 | MODULAIRE GLOBAL FINANCE PLC 8.000% 15/02/2023 | USD | 2.219.578,76 | 0,79 |
| | | | **4.336.823,01** | **1,54** |
| | **Luxemburg** | | | |
| 450.000 | ALTICE FINANCING SA 2.250% 15/01/2025 | EUR | 501.970,21 | 0,18 |
| 1.750.000 | ALTICE FRANCE HOLDING SA 10.500% 15/05/2027 | USD | 1.910.312,51 | 0,67 |
| 200.000 | ALTICE FRANCE HOLDING SA 6.000% 15/02/2028 | USD | 190.813,68 | 0,07 |
| 1.400.000 | ARD FINANCE SA 5.000% 30/06/2027 | EUR | 1.685.564,22 | 0,60 |
| 750.000 | GALAPAGOS HOLDING SA 7.000% 15/06/2022 - DEFAULTED | EUR | 26.076,37 | 0,01 |
| | | | **4.314.736,99** | **1,53** |
| | **Supranational-Multinational** | | | |
| 643.000 | ALLIED UNIVERSAL HOLDCO LLC/ALLIED UNIVERSAL FINANCE CORP/ATLAS LUXCO 4 SARL 3.625% 01/06/2028 | EUR | 732.209,88 | 0,26 |
| 2.510.000 | CLARIOS GLOBAL LP / CLARIOS US FINANCE CO 8.500% 15/05/2027 | USD | 2.670.466,51 | 0,94 |
| | | | **3.402.676,39** | **1,20** |
| | **Panama** | | | |
| 1.250.000 | CARNIVAL CORP 10.500% 01/02/2026 | USD | 1.449.572,69 | 0,51 |
| 1.350.000 | CARNIVAL CORP 1.875% 07/11/2022 | EUR | 1.553.684,25 | 0,56 |
| 302.000 | CARNIVAL CORP 7.625% 01/03/2026 | USD | 322.303,36 | 0,11 |
| | | | **3.325.560,30** | **1,18** |
| | **Niederlande** | | | |
| 1.500.000 | DARLING GLOBAL FINANCE BV 3.625% 15/05/2026 | EUR | 1.768.749,66 | 0,62 |
| 1.200.000 | DIEBOLD NIXDORF DUTCH HOLDING BV 9.000% 15/07/2025 | EUR | 1.509.585,92 | 0,54 |
| | | | **3.278.335,58** | **1,16** |
| | **Kaimaninseln** | | | |
| 1.784.399 | GLOBAL AIRCRAFT LEASING CO LTD 6.500% 15/09/2024 | USD | 1.760.410,45 | 0,62 |
| 1.070.000 | TRANSOCEAN POSEIDON LTD 6.875% 01/02/2027 | USD | 1.067.661,15 | 0,38 |
| | | | **2.828.071,60** | **1,00** |
| | **Liberia** | | | |
| 90.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 10.875% 01/06/2023 | USD | 100.700,24 | 0,04 |
| 1.096.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 11.500% 01/06/2025 | USD | 1.251.310,67 | 0,43 |
| 400.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 5.250% 15/11/2022 | USD | 411.166,39 | 0,15 |
| 800.000 | ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD 9.125% 15/06/2023 | USD | 869.956,82 | 0,31 |
| | | | **2.633.134,12** | **0,93** |
| | **Bermuda** | | | |
| 1.725.000 | NCL CORP LTD 3.625% 15/12/2024 | USD | 1.638.235,97 | 0,58 |
| 265.000 | NCL CORP LTD 5.875% 15/03/2026 | USD | 271.700,86 | 0,10 |
| | | | **1.909.936,83** | **0,68** |
| | **Frankreich** | | | |
| 1.679.000 | ALTICE FRANCE SA 3.375% 15/01/2028 | EUR | 1.872.906,63 | 0,66 |
| | | | **1.872.906,63** | **0,66** |
| | **Dänemark** | | | |
| 1.600.000 | DKT FINANCE APS 9.375% 17/06/2023 | USD | 1.632.650,99 | 0,58 |
| | | | **1.632.650,99** | **0,58** |
| | **Jersey** | | | |
| 1.250.000 | AVIS BUDGET FINANCE PLC 4.750% 30/01/2026 | EUR | 1.480.275,34 | 0,52 |
| | | | **1.480.275,34** | **0,52** |
| | | | **272.263.481,93** | **96,49** |
| **Wertpapierbestand Gesamt** | | | **272.263.481,93** | **96,49** |

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021

| Zu erhalten | | Zu zahlen | | Fälligkeitsdatum | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|---|---|
| **Devisentermingeschäfte** | | | | | | |
| 21.476.168,92 | USD | 18.361.573,37 | EUR | 29/10/2021 | 21.476.168,92 | 185.660,28 |
| 69.424,80 | USD | 51.000,00 | GBP | 29/10/2021 | 69.424,80 | 656,61 |
| | | | | | **21.545.593,72** | **186.316,89** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# NN (L) US High Yield

*(ausgedrückt in USD)*

## Derivative Finanzinstrumente zum 30.09.2021 (Fortsetzung)

| Stückzahl | Bezeich-nung | Währung | Engagement in USD | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) in USD |
|---|---|---|---|---|
| | **Zins-Futures** | | | |
| (30) | EURO-BOBL FUTURE 08/12/2021 | EUR | 4.691.313,63 | 26.424,06 |
| (22) | EURO-BUND FUTURE 08/12/2021 | EUR | 4.329.883,49 | 60.427,65 |
| | | | **9.021.197,12** | **86.851,71** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | | | | **273.168,60** |

## Nettovermögen zum 30.09.2021 im Überblick

| | | % NIW |
|---|---|---|
| **Wertpapierbestand Gesamt** | **272.263.481,93** | **96,49** |
| **Derivative Finanzinstrumente Gesamt** | **273.168,60** | **0,10** |
| **Bankguthaben** | **6.310.592,91** | **2,24** |
| **Sonstige Vermögenswerte und Verbindlichkeiten** | **3.306.313,31** | **1,17** |
| **Nettovermögen Gesamt** | **282.153.556,75** | **100,00** |

Die Erläuterungen sind wesentlicher Bestandteil dieses Abschlusses.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen

## 1- ALLGEMEINE INFORMATIONEN

NN (L) (die „Gesellschaft“ oder die „SICAV“ oder der „Fonds“) ist eine in Form einer Aktiengesellschaft (Société Anonyme) am 6. September 1993 auf unbestimmte Zeit gegründete „Société d'Investissement à Capital Variable“ (SICAV, Investmentgesellschaft mit variablem Kapital), die den Bestimmungen von Teil I des Luxemburger Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen in geänderter Fassung unterliegt.

Die Gründungsurkunde und die Satzung der Gesellschaft wurden im „Mémorial C, Recueil Spécial des Sociétés et Associations“ (Amtsblatt) des Großherzogtums Luxemburg veröffentlicht und bei der Geschäftsstelle des „Tribunal d'Arrondissement“ (Bezirksgericht) in Luxemburg hinterlegt, wo sie eingesehen werden können und gegen Zahlung der Gerichtsgebühren Kopien erhältlich sind.

Die Gesellschaft ist im Registre de Commerce et des Sociétés (Handels- und Gesellschaftsregister) in Luxemburg unter der Nummer B 44 873 eingetragen.

Die Gesellschaft gibt derzeit folgende Anteilsklassen aus:

| Bezeichnung der Anteilsklasse | Beschreibung |
|---|---|
| Capitalisation I | Thesaurierende Anteile für institutionelle Anleger. |
| Capitalisation I Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende thesaurierende Anteile.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Capitalisation M | Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile. Die Anteilsklasse unterscheidet sich von der Klasse „I“ durch ihre maximale Verwaltungsgebühr von 1,5% und ihre Zeichnungsgebühr von höchstens 5%. Sie wird durch verbundene Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft oder nach Ermessen des Verwaltungsrats durch Vertriebsstellen und/oder in bestimmten Ländern, in denen die Marktbedingungen diese Gebührenstruktur erfordern, vertrieben. |
| Capitalisation N | Thesaurierende Anteile, die keine Rückvergütungen zahlen und für Privatanleger bestimmt sind, die ihr Wertpapierkonto in den Niederlanden bei einem regulierten niederländischen Finanzinstitut unterhalten. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“.<br>Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. |
| Capitalisation N Hedged* | Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte thesaurierende Anteile; diese Anteilsklasse zahlt keine Rückvergütungen und ist in einer anderen Währung als der Referenzwährung des Teilfonds denominiert. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“.<br>Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Capitalisation O | Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“. |
| Capitalisation O Hedged* | Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Capitalisation P | Thesaurierende Anteile für Privatanleger. |
| Capitalisation P Hedged* | Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Bezeichnung der Anteilsklasse | Beschreibung |
|---|---|
| Capitalisation Q | Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „Q“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „I“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „Q“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „I“. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. |
| Capitalisation R | Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“.<br>Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“. |
| Capitalisation R Hedged* | Thesaurierende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Capitalisation S | Thesaurierende Anteile für institutionelle wirtschaftliche Eigentümer mit einer Mindestzeichnung von EUR 1.000.000 oder dem Gegenwert; sie unterliegen einer Zeichnungssteuer auf das Nettovermögen von 0,05% pro Jahr. |
| Capitalisation T | Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile. Die Anteilsklasse unterscheidet sich von der Klasse „I“ durch ihre niedrigere oder gleiche Verwaltungsgebühr und ihre Zeichnungsgebühr von höchstens 5%. Sie wird durch verbundene Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft oder nach Ermessen des Verwaltungsrats durch Vertriebsstellen und/oder in bestimmten Ländern, in denen die Marktbedingungen diese Gebührenstruktur erfordern, vertrieben. |
| Capitalisation U | Thesaurierende Anteile, für die keine Rückvergütungen gezahlt werden und die ausgewählten institutionellen Anlegern mit Hauptsitz in der Schweiz im Rahmen einer Vermögensverwaltung vorbehalten sind, die eine spezielle U-Anteilsklassen-Vereinbarung mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen in Bezug auf ihre Anlagen in der Gesellschaft geschlossen haben. Die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „U“ sind nicht höher als die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „I“, die im jeweiligen Teilfonds-Factsheet näher beschrieben sind. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. |
| Capitalisation U Hedged* | Thesaurierende Anteile, für die keine Rückvergütungen gezahlt werden und die ausgewählten institutionellen Anlegern mit Hauptsitz in der Schweiz im Rahmen einer Vermögensverwaltung vorbehalten sind, die eine spezielle U-Anteilsklassen-Vereinbarung mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen in Bezug auf ihre Anlagen in der Gesellschaft geschlossen haben. Die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „U“ sind nicht höher als die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „I“, die im jeweiligen Teilfonds-Factsheet näher beschrieben sind. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. Die Anteilsklasse lautet auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Capitalisation V | Für institutionelle Anleger bestimmte thesaurierende Anteile. Die Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „I“ durch ihre höhere Verwaltungsgebühr. |
| Capitalisation X | Thesaurierende Anteile für Privatanleger. Diese Klasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. |
| Capitalisation X Hedged* | Thesaurierende Anteile für Privatanleger. Diese Klasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Bezeichnung der Anteilsklasse | Beschreibung |
|---|---|
| Capitalisation Y | Für Privatanleger bestimmte thesaurierende Anteile, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die mit der Verwaltungsgesellschaft bestimmte Vertriebsvereinbarungen abgeschlossen haben; die Anteilsklasse unterliegt einer bedingt aufgeschobenen Verkaufsgebühr („Contingent Deferred Sales Charge", CDSC). Die Anteilsklasse unterscheidet sich jedoch von der Anteilsklasse „X" dahingehend, dass für sie eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1% erhoben wird.<br>Für diese Anteile sind keine Zeichnungsgebühren zu zahlen. |
| Capitalisation Y Hedged* | Für Privatanleger bestimmte thesaurierende Anteile, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die mit der Verwaltungsgesellschaft bestimmte Vertriebsvereinbarungen abgeschlossen haben; die Anteilsklasse unterliegt einer bedingt aufgeschobenen Verkaufsgebühr („Contingent Deferred Sales Charge", CDSC). Die Anteilsklasse unterscheidet sich jedoch von der Anteilsklasse „X" dahingehend, dass für sie eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1% erhoben wird, und dass sie auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautet.<br>Für diese Anteile sind keine Zeichnungsgebühren zu zahlen.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Capitalisation Z | Für institutionelle Anleger bestimmte thesaurierende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung") geschlossen haben.<br>Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen.<br>Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung. |
| Capitalisation Z Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte thesaurierende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung") geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Capitalisation Zz | Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile, die sich von Anteilen der Anteilsklasse „Z" dadurch unterscheiden, dass die Verwaltungsgesellschaft eine die Verwaltungsgebühr abdeckende Servicegebühr für die Fondsverwaltung, die Servicegebühr und etwaige andere Gebühren direkt von den Anteilseignern gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen („Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen") erhebt und einzieht, die mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen abgeschlossen wurde. |
| Capitalisation Zz Hedged* | Institutionellen Anlegern vorbehaltene thesaurierende Anteile, die sich von Anteilen der Anteilsklasse „Z" dadurch unterscheiden, dass die Verwaltungsgesellschaft eine die Verwaltungsgebühr abdeckende Servicegebühr für die Fondsverwaltung, die Servicegebühr und etwaige andere Gebühren direkt von den Anteilseignern gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen („Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen") erhebt und einzieht, die mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen abgeschlossen wurde, und dass diese auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution D (Q) | Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte ausschüttende Anteilsklasse - vierteljährliche Ausschüttung.<br>Für diese Anteile sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. |
| Distribution I | Ausschüttende Anteile für institutionelle Anleger. |
| Distribution I Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution I (HY) Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile – halbjährliche Ausschüttung.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution I (M) | Ausschüttende Anteile für institutionelle Anleger - monatliche Ausschüttung. |
| Distribution I (M) Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile – monatliche Ausschüttung.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Bezeichnung der Anteilsklasse | Beschreibung |
|---|---|
| Distribution I (Q) | Ausschüttende Anteile für institutionelle Anleger - vierteljährliche Ausschüttung. |
| Distribution I (Q) Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile – vierteljährliche Ausschüttung.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution N | Ausschüttende Anteile, die keine Rückvergütungen zahlen und für Privatanleger bestimmt sind, die ihr Wertpapierkonto in den Niederlanden bei einem regulierten niederländischen Finanzinstitut unterhalten. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“.<br>Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. |
| Distribution N Hedged* | Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile; diese Anteilsklasse zahlt keine Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution N (Q) | Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte ausschüttende Anteile; diese Anteilsklasse zahlt keine Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“ – vierteljährliche Ausschüttung. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen. |
| Distribution N (Q) Hedged* | Für Privatanleger am niederländischen Markt bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile; diese Anteilsklasse zahlt keine Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „N“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „N“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“ – vierteljährliche Ausschüttung.<br>Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution O | Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“. |
| Distribution O Hedged* | Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution O (Q) | Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die Kunden von Vertriebstellen sind, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft eine Vereinbarung über die Anteilsklasse „O“ mit der Verwaltungsgesellschaft abgeschlossen haben, die Anlagen in die Gesellschaft seitens ihrer Kunden betrifft. Diese Anteilsklasse zahlt weder Retrozessionen noch Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „O“ ist niedriger als die maximale Gebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „O“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“. Die maximale Zeichnungsgebühr und die Umtauschgebühr der Anteilsklasse „O“ entspricht der maximalen Zeichnungsgebühr und der Umtauschgebühr der Anteilsklasse „P“ - vierteljährliche Ausschüttung. |
| Distribution P | Ausschüttende Anteile für Privatanleger. |
| Distribution P Hedged* | Für Privatanleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution P (M) | Ausschüttende Anteile für Privatanleger - monatliche Ausschüttung. |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Bezeichnung der Anteilsklasse | Beschreibung |
|---|---|
| Distribution P (M) Hedged* | Für Privatanleger bestimmte und auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautende ausschüttende Anteile - monatliche Ausschüttung.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution P (Q) | Ausschüttende Anteile für Privatanleger - vierteljährliche Ausschüttung. |
| Distribution R | Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“.<br>Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“.<br>Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“. |
| Distribution R Hedged* | Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“. Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“.<br>Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution R (Q) | Ausschüttende Anteile für Privatanleger, die sich an Kunden von Vertriebsstellen richten, die Anlageberatung auf Basis einer separaten Gebührenvereinbarung bieten. Diese Anteilsklasse zahlt keine Retrozessionen oder Rückvergütungen. Die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „R“ ist niedriger als die maximale Verwaltungsgebühr für die Anteilsklasse „P“.<br>Die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „R“ entspricht derjenigen der Anteilsklasse „P“.<br>Die maximalen Zeichnungs- und Umtauschgebühren der Anteilsklasse „R“ entsprechen denjenigen der Anteilsklasse „P“ - vierteljährliche Ausschüttung. |
| Distribution T | Institutionellen Anlegern vorbehaltene ausschüttende Anteile. Die Anteilsklasse unterscheidet sich von der Klasse „I“ durch ihre niedrigere oder gleiche Verwaltungsgebühr und ihre Zeichnungsgebühr von höchstens 5%. Sie wird durch verbundene Unternehmen der Verwaltungsgesellschaft oder nach Ermessen des Verwaltungsrats durch Vertriebsstellen und/oder in bestimmten Ländern, in denen die Marktbedingungen diese Gebührenstruktur erfordern, vertrieben. |
| Distribution U (M) | Ausschüttende Anteile, für die keine Rückvergütungen gezahlt werden und die ausgewählten institutionellen Anlegern mit Hauptsitz in der Schweiz im Rahmen einer Vermögensverwaltung vorbehalten sind, die eine spezielle U-Anteilsklassen-Vereinbarung mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen in Bezug auf ihre Anlagen in der Gesellschaft geschlossen haben. Die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „U“ sind nicht höher als die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „I“, die im jeweiligen Teilfonds-Factsheet näher beschrieben sind. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen - monatliche Ausschüttung. |
| Distribution U (Q) | Ausschüttende Anteile, für die keine Rückvergütungen gezahlt werden und die ausgewählten institutionellen Anlegern mit Hauptsitz in der Schweiz im Rahmen einer Vermögensverwaltung vorbehalten sind, die eine spezielle U-Anteilsklassen-Vereinbarung mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen in Bezug auf ihre Anlagen in der Gesellschaft geschlossen haben. Die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „U“ sind nicht höher als die maximale Verwaltungsgebühr, das gegebenenfalls anfallende Erfolgshonorar und die feste Servicegebühr für die Anteilsklasse „I“, die im jeweiligen Teilfonds-Factsheet näher beschrieben sind. Für diese Anteilsklassenart sind keine Zeichnungs- oder Umtauschgebühren zu zahlen - vierteljährliche Ausschüttung. |
| Distribution X | Ausschüttende Anteile für Privatanleger. Diese Klasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. |
| Distribution X Hedged* | Ausschüttende Anteile für Privatanleger. Diese Klasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Bezeichnung der Anteilsklasse | Beschreibung |
|---|---|
| Distribution X (M) | Ausschüttende Anteile für Privatanleger - monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. |
| Distribution X (M) Hedged* | Ausschüttende Anteile für Privatanleger - monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution X (Q) | Für Privatanleger bestimmte ausschüttende Anteile - vierteljährliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. |
| Distribution X (Q) Hedged* | Für Privatanleger bestimmte ausschüttende Anteile - vierteljährliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse unterscheidet sich von der Anteilsklasse „P“ dadurch, dass die Verwaltungsgebühr höher ist, weil die Anteile in Ländern vertrieben werden, in denen die Marktbedingungen eine höhere Gebühr erfordern. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution Y (M) | Für Privatanleger bestimmte ausschüttende Anteile - monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse richtet sich an Kunden von Vertriebsstellen, die mit der Verwaltungsgesellschaft bestimmte Vertriebsvereinbarungen abgeschlossen haben; die Anteilsklasse unterliegt einer bedingt aufgeschobenen Verkaufsgebühr („Contingent Deferred Sales Charge“, CDSC). Die Anteilsklasse unterscheidet sich jedoch von der Anteilsklasse „X“ dahingehend, dass für sie eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1% erhoben wird.<br>Für diese Anteile sind keine Zeichnungsgebühren zu zahlen. |
| Distribution Y (M) Hedged* | Für Privatanleger bestimmte ausschüttende Anteile - monatliche Ausschüttung. Diese Anteilsklasse richtet sich an Kunden von Vertriebsstellen, die mit der Verwaltungsgesellschaft bestimmte Vertriebsvereinbarungen abgeschlossen haben; die Anteilsklasse unterliegt einer bedingt aufgeschobenen Verkaufsgebühr („Contingent Deferred Sales Charge“, CDSC). Die Anteilsklasse unterscheidet sich jedoch von der Anteilsklasse „X“ dahingehend, dass für sie eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1% erhoben wird, und dass sie auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lautet.<br>Für diese Anteile sind keine Zeichnungsgebühren zu zahlen. Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution Z | Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben.<br>Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung. |
| Distribution Z Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds.<br>Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution Z (HY) Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds - halbjährliche Ausschüttung.<br>Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Bezeichnung der Anteilsklasse | Beschreibung |
|---|---|
| Distribution Z (M) Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds - monatliche Ausschüttung.<br>Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution Z (Q) Hedged* | Für institutionelle Anleger bestimmte ausschüttende Anteile, die nach Ermessen der Verwaltungsgesellschaft neben der Zeichnungsvereinbarung in Verbindung mit ihrer Anlage in dem Fonds eine besondere Verwaltungsvereinbarung („Sondervereinbarung“) geschlossen haben. Die Anteile lauten auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds - vierteljährliche Ausschüttung.<br>Für diese Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr gemäß der Sondervereinbarung durch die Verwaltungsgesellschaft direkt beim Anteilsinhaber erhoben und eingezogen. Für Anlagen in diese Anteilsklasse gilt ein Mindestbestand von EUR 5.000.000 oder dem Gegenwert in einer anderen Währung.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |
| Distribution Zz Hedged* | Institutionellen Anlegern vorbehaltene ausschüttende Anteile, die sich von Anteilen der Anteilsklasse „Z“ dadurch unterscheiden, dass die Verwaltungsgesellschaft eine die Verwaltungsgebühr abdeckende Servicegebühr für die Fondsverwaltung, die Servicegebühr und etwaige andere Gebühren direkt von den Anteilseignern gemäß den Bestimmungen der Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen („Vereinbarung zu den Fondsverwaltungsdienstleistungen“) erhebt und einzieht, die mit der Verwaltungsgesellschaft nach deren Ermessen abgeschlossen wurde, und dass diese auf eine andere Währung als die Referenzwährung des Teilfonds lauten.<br>Diese Anteilsklasse verwendet Techniken zur Absicherung gegen die Referenzwährung des Teilfonds. |

*Beabsichtigt ist, den Wert des Nettovermögens teilweise oder vollständig in der Referenzwährung des Teilfonds abzusichern oder das Währungsrisiko einiger (jedoch nicht notwendigerweise aller) Vermögenswerte des betreffenden Teilfonds entweder gegen die Referenzwährung der Anteilsklasse mit Währungsabsicherung oder gegen eine andere Währung abzusichern. Es ist allgemein beabsichtigt, diese Absicherung durch den Einsatz verschiedener derivativer Finanzinstrumente zu erreichen, einschließlich unter anderem außerbörslicher („OTC“) Devisenterminkontrakte und Devisen-Swapgeschäfte. Aus solchen Absicherungsgeschäften entstandene Gewinne und Verluste werden der/den entsprechenden Anteilsklasse(n) mit Währungsabsicherung zugerechnet.

Zu den Techniken, die für die Absicherung einer Anteilsklasse verwendet werden, können folgende gehören:
i. Absicherungsgeschäfte zur Reduzierung der Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Währung, auf die die Anteilsklasse lautet, und der Referenzwährung des betreffenden Teilfonds („Basiswährungsabsicherung“);
ii. Absicherungsgeschäfte zur Reduzierung der Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Währungsposition, die sich aus dem Bestand des entsprechenden Teilfonds ergibt, und der Währung, auf welche die Anteilsklasse lautet, („Portfolioabsicherung auf Anteilsklassenebene“);
iii. Absicherungsgeschäfte zur Reduzierung der Auswirkungen von Wechselkursschwankungen zwischen der Währungsposition, die sich aus dem Bestand der relevanten Benchmark ergibt, und der Währung, auf welche die Anteilsklasse lautet, („Benchmarkabsicherung auf Anteilsklassenebene“);
iv. Absicherungsgeschäfte zur Reduzierung der Auswirkungen von Wechselkursschwankungen auf Basis der Korrelationen zwischen den Währungen, die sich aus dem Bestand des entsprechenden Teilfonds ergeben, und der Währung, auf welche die Anteilsklasse lautet, („Proxyabsicherung auf Anteilsklassenebene“).
Anleger werden darauf hingewiesen, dass nicht jede Anteilsklasse von jedem Teilfonds der Gesellschaft angeboten wird.

**Anlagepolitik**

Die Anlagepolitik der einzelnen Teilfonds wird im Verkaufsprospekt ausführlich beschrieben. Letzterer ist bei der Depotbank sowie am eingetragenen Sitz der Gesellschaft und bei den im vorliegenden Bericht aufgeführten lokalen Vertriebsstellen oder Hauptansprechpartnern in der Kundenbetreuung erhältlich. Darüber hinaus wird er auf Anfrage kostenlos versandt.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Die nachfolgend genannten Teilfonds sind in andere Teilfonds des Fonds investiert. Zum 30. September 2021 betrifft dies folgende Anlagen:

| Investierender Teilfonds | Investierter Teilfonds | Marktwert der Anlage zum 30. September 2021 |
|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | 8.156.381,44 USD |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | 101.932.993,51 USD |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency) | 98.761.364,95 USD |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | 233.111.359,93 USD |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency) | NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency) | 3.833.232,25 USD |
| NN (L) Euro Fixed Income | NN (L) AAA ABS | 53.511.204,34 EUR |
| NN (L) Euro Fixed Income | NN (L) European ABS | 27.152.931,08 EUR |
| NN (L) Euro Long Duration Bond | NN (L) European ABS | 19.407.453,56 EUR |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | NN (L) First Class Stable Yield Opportunities | 15.256.056,84 EUR |
| NN (L) Global Convertible Opportunities | NN (L) Global Convertible Bond | 27.300.485,00 USD |
| NN (L) Global High Yield | NN (L) Asian High Yield | 54.053.032,61 EUR |
| NN (L) Global High Yield | NN (L) European High Yield | 35.950.850,00 EUR |
| NN (L) Global High Yield | NN (L) US High Yield | 84.238.611,57 EUR |
| NN (L) Multi Asset High Income | NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | 360.253,08 EUR |
| NN (L) Multi Asset High Income | NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | 224.958,88 EUR |
| NN (L) Multi Asset High Income | NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity | 269.136,57 EUR |
| NN (L) Multi Asset High Income | NN (L) European ABS | 284.769,54 EUR |
| NN (L) Multi Asset High Income | NN (L) European High Dividend | 669.849,72 EUR |
| NN (L) Multi Asset High Income | NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity | 327.031,88 EUR |
| NN (L) Multi Asset High Income | NN (L) Global High Yield | 1.030.500,04 EUR |
| NN (L) Multi Asset High Income | NN (L) Global Sustainable Equity | 1.041.975,66 EUR |
| NN (L) Multi Asset High Income | NN (L) US High Yield | 117.589,13 EUR |

Der konsolidierte Abschluss wird auf Grundlage der Zusammenfassung der Abschlüsse der einzelnen Teilfonds ohne Abzug etwaiger Überkreuzbeteiligungen berechnet. Zum 30. September 2021 machten die Überkreuzbeteiligungen innerhalb des Fonds 702.106.934,05 EUR oder 1,89% des aufaddierten Nettovermögens aus. Die Anlage beim Fonds NN (L) Liquid wurde in der Tabelle nicht berücksichtigt, da er nicht zu den NN (L)-Teilfonds gehört.

**Änderungen**

Zwecks ökonomischer Rationalisierung und im Einklang mit den Bestimmungen des Artikels 26 der Satzung, Kapitel XV des Prospekts und Artikel 1 Absatz 20 Buchstabe a des Luxemburgischen Gesetzes vom 17. Dezember 2010 über Organismen für gemeinsame Anlagen (das „Gesetz von 2010“) hat der Verwaltungsrat eine grenzüberschreitende Verschmelzung (die „grenzüberschreitende Verschmelzung“) beschlossen, die aus drei einzelnen Verschmelzungen besteht (einzeln „Verschmelzung 1“, „Verschmelzung 2“ und „Verschmelzung 3“ genannt). Die in den drei nachstehenden Tabellen aufgeführten aufgenommenen Teilfonds (die „aufgenommenen Teilfonds“) wurden auf die ebenfalls in diesen Tabellen aufgeführten aufnehmenden Teilfonds der Gesellschaft (die „aufnehmenden Teilfonds“) verschmolzen. Die aufnehmenden Teilfonds waren Teil eines niederländischen Fonds namens „NN Paraplufonds 1 NV“.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

*Verschmelzung mit Wirksamkeitstag 5. Oktober 2020*

| Aufgenommener Teilfonds und Anteilsklassen | | Aufnehmender Teilfonds und Anteilsklassen | | Umtauschverhältnis der Anteile |
|---|---|---|---|---|
| NN Basic Materials Fund | P-Anteile | NN (L) Climate & Environment | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 1,092188 |
| NN Energy Fund | P-Anteile | NN (L) Climate & Environment | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 0,385066 |
| NN Industrials Fund | P-Anteile | NN (L) Climate & Environment | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 1,171718 |
| NN Utilities Fund | P-Anteile | NN (L) Climate & Environment | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 1,037185 |

*Verschmelzung mit Wirksamkeitstag 7. Oktober 2020*

| Aufgenommener Teilfonds und Anteilsklassen | | Aufnehmender Teilfonds und Anteilsklassen | | Umtauschverhältnis der Anteile |
|---|---|---|---|---|
| NN Financials Fund | P-Anteile | NN (L) Smart Connectivity | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 0,326998 |
| NN Information Technology Fund | P-Anteile | NN (L) Smart Connectivity | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 3,206949 |
| NN Communication Services Fund | P-Anteile | NN (L) Smart Connectivity | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 0,720953 |

*Verschmelzung mit Wirksamkeitstag 9. Oktober 2020*

| Aufgenommener Teilfonds und Anteilsklassen | | Aufnehmender Teilfonds und Anteilsklassen | | Umtauschverhältnis der Anteile |
|---|---|---|---|---|
| NN Daily Consumer Goods Fund | P-Anteile | NN (L) Health & Well-being | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 1,711412 |
| NN Health Care Fund | P-Anteile | NN (L) Health & Well-being | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 1,608786 |
| NN Health Care Fund | O-Anteile | NN (L) Health & Well-being | Ausschüttende O-Anteile (EUR) | 0,008035 |
| NN Luxury Consumer Goods Fund | P-Anteile | NN (L) Health & Well-being | Ausschüttende N-Anteile (EUR) | 1,711412 |

Am 17. November 2020 erfolgte eine Ausschüttung in Form einer Sachleistung aus dem Teilfonds NN (L) US Credit.

Von der Auflegung des Teilfonds NN (L) Global Convertible Income wurde Abstand genommen.

Der Teilfonds NN (L) Sovereign Green Bond wurde am 31. März 2021 aufgelegt (1. NIW: 1. April 2021).

Der Teilfonds NN (L) US Behavioural Equity wurde am 10. Mai 2021 aufgelegt (1. NIW: 11. Mai 2021).

Am 19. August 2021 kündigte die NN Group an, dass eine Vereinbarung über den Verkauf ihrer Verwaltungsgesellschaft NN Partners (NN IP) an die Goldman Group Inc. (Goldman Sachs) erzielt wurde. Der Vereinbarung ging eine strategische Überprüfung voraus, die am 26. April 2021 angekündigt und von der NN Group mit dem Ziel durchgeführt wurde, eine langfristige Wertschöpfung anzustreben, die allen Stakeholdern zugutekommt. Der Vollzug der Transaktion unterliegt den üblichen Bedingungen, darunter die notwendigen Genehmigungen der Aufsichts- und Wettbewerbsbehörden und die Anhörung des Betriebsrats von NN IP in den Niederlanden. Der vollständige Vollzug der Transaktion wird für das erste Quartal 2022 erwartet. Bis zum Vollzug werden NN IP und Goldman Sachs weiterhin als zwei getrennte Unternehmen handeln.

Der Teilfonds NN (L) US Growth Equity wurde am 22. September 2021 liquidiert.

## 2- ZUSAMMENFASSUNG DER WESENTLICHEN RECHNUNGSLEGUNGSGRUNDSÄTZE

Die Finanzabschlüsse werden unter der Unternehmensfortführungsprämisse erstellt. Ausgenommen davon sind die Finanzabschlüsse des Teilfonds NN (L) US Growth Equity, die auf Grundlage der Nichtfortführung der Geschäftstätigkeit erstellt wurden. Die Finanzabschlüsse werden gemäß den allgemein anerkannten und in Luxemburg geltenden Bilanzierungsgrundsätzen und -vorschriften dargestellt.

**Währungsumrechnung**

Die Finanzabschlüsse wurden in der Rechnungswährung des jeweiligen Teilfonds erstellt. Vermögenswerte und Verbindlichkeiten in anderen Währungen als der Rechnungswährung der jeweiligen Teilfonds werden zu den am Bilanzstichtag gültigen Wechselkursen umgerechnet.

Erträge und Aufwendungen in anderen Währungen als der Rechnungswährung des Teilfonds werden zu dem am Transaktionstag gültigen Wechselkurs umgerechnet.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Die verschiedenen Posten der konsolidierten Abschlüsse entsprechen der Summe der betreffenden Posten in den Finanzabschlüssen der einzelnen Teilfonds, die gegebenenfalls in EUR (Konsolidierungswährung der Gesellschaft) zu den am Abschlussstichtag geltenden Wechselkursen umgerechnet wurden.

Die Bewertungsdifferenz, die sich beim Nettovermögen der Teilfonds zu Beginn des Jahres durch die Umrechnung mit dem zum Datum des Finanzabschlusses geltenden Wechselkurs ergibt, ist im Posten „Umrechnungsdifferenz“ in der konsolidierten Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens ausgewiesen.

Zum 30. September 2021 wurden folgende Wechselkurse zugrunde gelegt:

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 EUR = | 4,2570 | AED | 1 EUR = | 9,0220 | HKD | 1 EUR = | 59,1180 | PHP |
| | 1,6044 | AUD | | 359,2150 | HUF | | 4,6025 | PLN |
| | 99,2467 | BDT | | 16.587,4723 | IDR | | 4,2197 | QAR |
| | 6,3150 | BRL | | 3,7389 | ILS | | 4,9495 | RON |
| | 1,4682 | CAD | | 86,0260 | INR | | 84,3542 | RUB |
| | 1,0811 | CHF | | 129,3098 | JPY | | 10,1391 | SEK |
| | 941,2993 | CLP | | 128,0640 | KES | | 1,5734 | SGD |
| | 7,4893 | CNY | | 1.372,1970 | KRW | | 39,2131 | THB |
| | 4.417,8366 | COP | | 23,8100 | MXN | | 10,2964 | TRY |
| | 25,3430 | CZK | | 4,8519 | MYR | | 32,2889 | TWD |
| | 1,9558 | DEM | | 479,5156 | NGN | | 1,1590 | USD |
| | 7,4359 | DKK | | 10,1168 | NOK | | 17,4364 | ZAR |
| | 18,2187 | EGP | | 1,6800 | NZD | | | |
| | 0,8595 | GBP | | 4,7918 | PEN | | | |

| | | |
|---|---|---|
| 1 JPY = | 0,1960 | CZK |
| | 0,0077 | EUR |
| | 0,0356 | PLN |
| | 0,0090 | USD |

| | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 1 USD = | 3,6732 | AED | 1 USD = | 0,8629 | EUR | 1 USD = | 1,4496 | NZD |
| | 98,7452 | ARS | | 0,7416 | GBP | | 4,1346 | PEN |
| | 1,3844 | AUD | | 6,0100 | GHS | | 51,0100 | PHP |
| | 5,4489 | BRL | | 7,7847 | HKD | | 3,9713 | PLN |
| | 1,2669 | CAD | | 309,9487 | HUF | | 3,6410 | QAR |
| | 0,9329 | CHF | | 14.312,5000 | IDR | | 4,2707 | RON |
| | 812,2000 | CLP | | 3,2262 | ILS | | 101,4550 | RSD |
| | 6,4540 | CNH | | 74,2275 | INR | | 72,7850 | RUB |
| | 6,4622 | CNY | | 111,5750 | JPY | | 8,7486 | SEK |
| | 3.811,9300 | COP | | 1.184,0000 | KRW | | 1,3576 | SGD |
| | 21,8672 | CZK | | 0,3016 | KWD | | 33,8350 | THB |
| | 1,6876 | DEM | | 20,5445 | MXN | | 8,8843 | TRY |
| | 6,4161 | DKK | | 4,1865 | MYR | | 27,8605 | TWD |
| | 56,3000 | DOP | | 413,7500 | NGN | | 42,8700 | UYU |
| | 15,7200 | EGP | | 8,7293 | NOK | | 15,0450 | ZAR |

**Bewertung der Wertpapiere im Portfolio**

Der Wert aller Vermögenswerte wird unter der Verantwortung des Verwaltungsrats der Gesellschaft ermittelt.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Die Bewertung der Vermögenswerte der Gesellschaft erfolgt für übertragbare Wertpapiere und Geldmarktinstrumente oder Derivate, die an einer amtlichen Börse zugelassen sind oder an einem anderen geregelten Markt gehandelt werden, auf Grundlage des letzten verfügbaren Kurses des Hauptmarktes, an dem diese Wertpapiere, Geldmarktinstrumente oder Derivate gehandelt werden, der von einem anerkannten und vom Verwaltungsrat der Gesellschaft genehmigten Listing Service bereitgestellt wird. Sind diese Kurse nicht repräsentativ für den Marktwert, erfolgt die Bewertung dieser Wertpapiere, Geldmarktinstrumente oder Derivate sowie anderer zugelassener Vermögenswerte auf Grundlage ihres voraussichtlichen Verkaufspreises, der vom Verwaltungsrat der Gesellschaft nach Treu und Glauben bestimmt wird.

Nicht an einem geregelten Markt notierte oder gehandelte Wertpapiere und Geldmarktinstrumente werden auf Grundlage des letzten verfügbaren Kurses bewertet, es sei denn, dieser Kurs ist nicht repräsentativ für ihren tatsächlichen Wert. In diesem Fall erfolgt die Bewertung auf Grundlage des voraussichtlichen Verkaufspreises des Wertpapiers, der nach Treu und Glauben vom Verwaltungsrat der Gesellschaft bestimmt wird.

Anlagen in Investmentfonds, börsennotiert oder nicht, werden auf Grundlage des letzten verfügbaren Nettoinventarwertes pro Aktie/Anteil bewertet.

Anleihen (einschließlich ABS) werden „clean“, d.h. ohne Zinsen, bewertet. Ausnahmen werden im Wertpapierbestand des betreffenden Teilfonds entsprechend angegeben. Anteile mit „Dirty“-Bewertung sind im Portfolio mit einem Sternchen gekennzeichnet. Der letzte bekannte Kurs der Anleihen ist der Geldkurs.

Die Bewertungsmethode des Fonds für Geldmarktinstrumente in den Geldmarktfonds erfüllt die Anforderungen der Geldmarktfondsverordnung (MMFR), die am 21. Januar 2019 in Kraft getreten ist. Das Bewertungsmodell sieht vor, dass die Bewertung von Geldmarktfonds täglich erfolgt. Die Vermögenswerte eines Geldmarktfonds werden, wann immer möglich, nach der Bewertung zu Marktpreisen bewertet.

Bei der Anwendung der Bewertung zu Marktpreisen:
a. wird der Vermögenswert eines Geldmarktfonds auf der vorsichtigen Seite des Geld-/Briefkurses bewertet, es sei denn, der Vermögenswert kann zum Mittelkurs glattgestellt werden;
b. wird ausschließlich auf Qualitätsmarktdaten zurückgegriffen; diese Daten werden anhand aller nachstehend genannten Faktoren bewertet:
    i. Anzahl und Qualität der Gegenparteien;
    ii. Volumen und Umsatz des betroffenen Vermögenswerts des Geldmarktfonds im Markt;
    iii. Umfang der Emission und Anteil, den der Geldmarktfonds kaufen oder verkaufen will.

Ist die Anwendung der Bewertung zu Marktpreisen nicht möglich oder weisen die Marktdaten nicht die erforderliche Qualität auf, wird der Vermögenswert eines Geldmarktfonds konservativ unter Anwendung der Bewertung zu Modellpreisen bewertet. Das Modell muss eine präzise Schätzung des dem Vermögenswert des Geldmarktfonds inhärenten Wertes liefern und sich auf alle folgenden aktuellen Schlüsselfaktoren stützen:
a. Volumen und Umsatz des betroffenen Vermögenswerts im Markt;
b. Umfang der Emission und Anteil, den der Geldmarktfonds kaufen oder verkaufen will;
c. das mit dem Vermögenswert verbundene Markt-, Zins- und Kreditrisiko.

Bei Anwendung der Bewertung zu Modellpreisen wird die Methode der Bewertung zu fortgeführten Anschaffungskosten nicht angewandt. Ein Geldmarktfonds berechnet den Nettoinventarwert pro Anteil als Differenz zwischen der Summe aller Vermögenswerte eines Geldmarktfonds und der Summe aller Verbindlichkeiten dieses Geldmarktfonds, die jeweils nach der Bewertung zu Marktpreisen oder der Bewertung zu Modellpreisen oder beiden Methoden bewertet wurden, geteilt durch die Gesamtzahl der Geldmarktfondsanteile.

Realisierte Gewinne und Verluste aus dem Anlagenportfolio werden auf Basis des durchschnittlichen Einstandspreises der veräußerten Wertpapiere berechnet.

**Bewertung von derivativen Finanzinstrumenten**

Der Wert aller Vermögenswerte wird unter der Verantwortung des Verwaltungsrats der Gesellschaft ermittelt.

Bei Swaps handelt es sich im Allgemeinen um Kontrakte, mit denen sich zwei Parteien verpflichten, während eines bestimmten Zeitraums zwei Zahlungsströme, die auf Grundlage eines nominellen Werts bestimmt werden, auszutauschen - den einen gegen den anderen. Die Zahlungsströme können an einen oder mehrere Zinssätze, Wechselkurse, Aktien, Indizes oder Kreditereignisse gekoppelt sein. Die Bewertung von Swapkontrakten erfolgt unter Heranziehung der Differenz zwischen dem Wert der prognostizierten Zahlungsströme, welche die Gegenpartei dem Teilfonds zu zahlen hat, und dem Wert der prognostizierten Zahlungsströme, die der Teilfonds seinen Gegenparteien schuldet. Swaps werden auf Grundlage ihres Marktwerts bewertet, der von mehreren Parametern abhängt (Indexstand, Marktzinssatz, Restlaufzeit des Swaps).

Positive Netto-Marktwerte der Swapkontrakte werden in der Nettovermögensaufstellung als Vermögenswerte, negative als Verbindlichkeiten unter „Derivative Finanzinstrumente Gesamt“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne (oder Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Ergebnisses werden in der Rubrik Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens erfasst.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Swaps werden „clean“, d.h. ohne Zinsforderungen/-verbindlichkeiten, bewertet. Ausnahmen sind bei den derivativen Finanzinstrumenten der einzelnen Teilfonds entsprechend gekennzeichnet. Zinsforderungen aus Swapgeschäften sind im Posten „Sonstige Vermögenswerte“ enthalten. Für Swapgeschäfte zu entrichtende Zinsen sind im Posten „Sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

Devisentermingeschäfte stellen Verpflichtungen dar, eine ausländische Währung auf Grundlage ihres zukünftigen Wechselkurses, der zum Zeitpunkt des Vertragsabschlusses festgelegt wird, zu kaufen oder zu verkaufen. Nicht verfallene Devisenterminkontrakte werden zum letzten an den Bewertungstagen oder dem Bilanzstichtag verfügbaren „Termin“-Kurs bewertet, und nicht realisierte Wertsteigerungen (oder Wertminderungen) werden erfasst. Positive Netto-Marktwerte der Devisenterminkontrakte werden in der Nettovermögensaufstellung als Vermögenswerte, negative als Verbindlichkeiten unter „Derivative Finanzinstrumente Gesamt“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne (oder Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Ergebnisses werden in der Rubrik Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens erfasst.

Future-Kontrakte werden auf Grundlage des letzten verfügbaren Marktpreises bewertet. Bei Abschluss von Future-Kontrakten wird eine Einschusszahlung (Initial Margin) geleistet. Nachschüsse (Variation Margins) werden in Abhängigkeit von den täglichen Schwankungen des Marktwerts des Kontrakts geleistet oder empfangen und vom Fonds als nicht realisierte Wertsteigerung oder Wertminderung erfasst. Positive Netto-Marktwerte der Future-Kontrakte werden in der Nettovermögensaufstellung als Vermögenswerte, negative als Verbindlichkeiten unter „Derivative Finanzinstrumente Gesamt“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne (oder Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Ergebnisses werden in der Rubrik Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens erfasst. Zur Berechnung der Nettobestände der Finanzinstrumente in der jeweiligen Währung werden die Bestände zu dem am Ende des Berichtszeitraums geltenden Wechselkurs umgerechnet.

An einer amtlichen Börse oder einem anderen geregelten Markt notierte Optionskontrakte werden zum letzten bekannten Marktpreis bewertet, oder, falls es mehrere Märkte gibt, zum letzten bekannten Preis des Hauptmarktes. Nicht an einer amtlichen Börse oder einem anderen geregelten Markt notierte Optionskontrakte werden zu ihrem letzten bekannten Marktwert oder in Ermangelung eines Marktwerts zu ihrem wahrscheinlichen Marktwert bewertet, der durch eine angemessene Schätzung des Verwaltungsrat des Fonds bestimmt wird.

Positive Netto-Marktwerte der Optionskontrakte werden in der Nettovermögensaufstellung als Vermögenswerte, negative als Verbindlichkeiten unter „Derivative Finanzinstrumente Gesamt“ ausgewiesen. Realisierte Gewinne (oder Verluste) und Veränderungen des nicht realisierten Ergebnisses werden in der Rubrik Ergebnisrechnung und Veränderungen des Nettovermögens erfasst.

**Erträge und Ausgaben**

Dividenden werden an dem Tag verbucht, an dem das Wertpapier an der Börse Ex-Dividende notiert wird (nach Abzug der Quellensteuer).
Zinsen laufen täglich auf.
Disagio- bzw. Agio-Beträge werden unter Zinsen aus Anleihen und anderen Schuldtiteln verrechnet.

**3- SWINGING SINGLE PRICING**

Es kann bei Teilfonds zu einer „Verwässerung“ des Nettoinventarwerts je Anteil kommen, da der Preis, zu dem Anleger Anteile des Teilfonds zeichnen oder zurückgeben, nicht die Transaktionskosten und sonstigen Kosten widerspiegelt, die anfallen, wenn der Anlageverwalter im Rahmen von Mittelzu- und -abflüssen aus diesen Zeichnungen oder Rücknahmen Geschäfte tätigen muss.

Um dies zu verhindern, kann die Methode des „Swinging Single Pricing“ (SSP) angewandt werden, die darauf abzielt, die erwarteten Transaktionskosten auszugleichen, die der Unterschied zwischen Kapitalzu- und -abflüssen nach sich zieht. Übersteigen die Nettotransaktionen mit Anteilen des Teilfonds an einem Bewertungstag einen vorher festgelegten Schwellenwert, kann der Nettoinventarwert des betreffenden Teilfonds nach oben oder unten angepasst werden, um die erwarteten Transaktionskosten zu kompensieren, die mit diesen Nettokapitalzu- bzw. -abflüssen verbunden sind. Der Verwaltungsrat ermittelt die Nettomittelzu- und -abflüsse auf Basis der zum Zeitpunkt der Berechnung des Nettoinventarwerts aktuellsten Daten.

Dieser vorab festgelegte Schwellenwert und die Swing-Faktoren werden regelmäßig überprüft und gegebenenfalls angepasst. Der maximale Swing-Faktor beträgt 1,50% des Nettoinventarwerts des betreffenden Teilfonds; von dieser Regelung ausgenommen sind Teilfonds, die in festverzinsliche Instrumente investieren und einen maximalen Swing-Faktor von 3,00% anwenden können.

Unter außergewöhnlichen Marktbedingungen kann der Verwaltungsrat im Falle umfangreicher Zeichungs-, Rücknahme- oder Umtauschanträge, die sich abträglich auf die Interessen der Anteilsinhaber auswirken können, nach eigenem Ermessen eine vorübergehende Erhöhung des Swing-Faktors über den maximalen Swing-Faktor hinaus genehmigen. Außergewöhnliche Marktbedingungen können unter anderem als Phasen mit erhöhter Marktvolatilität, mangelnder Liquidität, Schwierigkeiten bei der Zwischenschaltung von Händlern, ungeordneten Handelsbedingungen, Marktverwerfungen und großer Kluft zwischen Marktpreisen und Bewertungen definiert werden und könnten eine Folge höherer Gewalt sein (zu der unter anderem Kriegshandlungen, Unruhen oder Cybersabotage zählen).

Die aktuellen Schwellenwerte und Swing-Faktoren für die einzelnen Teilfonds werden auf der Website www.nnip.com veröffentlicht und aktualisiert.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Per 30. September 2021 wurde bei folgenden Teilfonds ein Swing-Faktor angewandt:

- NN (L) Asian Debt (Hard Currency),
- NN (L) European Real Estate,
- NN (L) Global High Dividend,
- NN (L) Green Bond,
- NN (L) Japan Equity.

Welche Teilfonds in dem am 30. September 2021 beendeten Berichtsjahr den Mechanismus des Swinging Single Pricing angewandt haben, ist aus der folgenden Liste zu entnehmen:

| Teilfonds | Schwellenwerte | Swing-Faktor Zeichnungen | Swing-Faktor Rücknahmen |
|---|---|---|---|
| NN (L) AAA ABS | 1,00% | 0,10% | 0,05% |
| NN (L) Alternative Beta | 1,00% | 0,02% | 0,02% |
| NN (L) Asia Income | 2,00% | 0,22% | 0,32% |
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | 0,50% | 0,23% | 0,50% |
| NN (L) Asian High Yield | 1,00% | 0,33% | 1,00% |
| NN (L) Climate & Environment | 1,00% | 0,14% | 0,12% |
| NN (L) Corporate Green Bond | 1,00% | 0,20% | 0,10% |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | 2,00% | 0,30% | 0,15% |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | 0,50% | 0,30% | 0,15% |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond) | 1,00% | 0,23% | 0,12% |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency) | 2,00% | 0,23% | 0,12% |
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity | 1,00% | 0,23% | 0,30% |
| NN (L) Emerging Markets High Dividend | 1,00% | 0,23% | 0,30% |
| NN (L) Energy | 2,00% | 0,08% | 0,05% |
| NN (L) Euro Covered Bond | 2,00% | 0,10% | 0,05% |
| NN (L) Euro Credit | 1,00% | 0,20% | 0,10% |
| NN (L) EURO Equity | 1,00% | 0,20% | 0,06% |
| NN (L) Euro Fixed Income | 1,00% | 0,09% | 0,05% |
| NN (L) Euro High Dividend | 1,00% | 0,20% | 0,06% |
| NN (L) Euro Long Duration Bond | 1,00% | 0,09% | 0,05% |
| NN (L) Euro Sustainable Credit | 1,00% | 0,20% | 0,10% |
| NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials) | 1,00% | 0,20% | 0,10% |
| NN (L) Euromix Bond | 1,00% | 0,04% | 0,02% |
| NN (L) European ABS | 1,00% | 0,17% | 0,08% |
| NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity | 2,00% | 0,21% | 0,06% |
| NN (L) European Equity | 2,00% | 0,21% | 0,06% |
| NN (L) European High Dividend | 1,00% | 0,21% | 0,06% |
| NN (L) European High Yield | 2,00% | 0,33% | 0,17% |
| NN (L) European Participation Equity | 2,00% | 0,60% | 0,55% |
| NN (L) European Real Estate | 2,00% | 0,27% | 0,12% |
| NN (L) European Sustainable Equity | 1,00% | 0,21% | 0,06% |
| NN (L) First Class Multi Asset | 1,00% | 0,12% | 0,07% |
| NN (L) First Class Multi Asset Premium | 2,00% | 0,13% | 0,07% |
| NN (L) First Class Stable Yield Opportunities | 2,00% | 0,26% | 0,13% |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | 1,00% | 0,27% | 0,14% |
| NN (L) Food & Beverages | 2,00% | 0,08% | 0,05% |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | 1,00% | 0,30% | 0,15% |
| NN (L) Global Convertible Bond | 2,00% | 0,47% | 0,23% |
| NN (L) Global Convertible Opportunities | 1,00% | 0,47% | 0,23% |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Schwellenwerte | Swing-Faktor Zeichnungen | Swing-Faktor Rücknahmen |
|---|---|---|---|
| NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity | 1,00% | 0,08% | 0,05% |
| NN (L) Global Equity Impact Opportunities | 1,00% | 0,14% | 0,12% |
| NN (L) Global High Dividend | 1,00% | 0,08% | 0,05% |
| NN (L) Global High Yield | 1,00% | 0,33% | 0,17% |
| NN (L) Global Inflation Linked Bond | 2,00% | 0,06% | 0,03% |
| NN (L) Global Investment Grade Credit | 2,00% | 0,20% | 0,10% |
| NN (L) Global Real Estate | 2,00% | 0,10% | 0,08% |
| NN (L) Global Sustainable Equity | 0,50% | 0,08% | 0,05% |
| NN (L) Greater China Equity | 1,00% | 0,24% | 0,31% |
| NN (L) Green Bond | 1,00% | 0,20% | 0,10% |
| NN (L) Green Bond Short Duration | 2,00% | 0,20% | 0,10% |
| NN (L) Health Care | 1,00% | 0,08% | 0,05% |
| NN (L) Japan Equity | 2,00% | 0,08% | 0,08% |
| NN (L) Multi Asset Factor Opportunities | 1,00% | 0,11% | 0,11% |
| NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity | 1,00% | 0,05% | 0,05% |
| NN (L) Sovereign Green Bond[(1)] | 2,00% | 0,20% | 0,10% |
| NN (L) US Credit | 0,50% | 0,20% | 0,10% |
| NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity | 1,00% | 0,05% | 0,05% |
| NN (L) US Factor Credit | 2,00% | 0,23% | 0,12% |
| NN (L) US Growth Equity[(2)] | 2,00% | 0,05% | 0,05% |
| NN (L) US High Dividend | 1,00% | 0,05% | 0,05% |
| NN (L) US High Yield | 1,00% | 0,33% | 0,17% |

[(1)] Der Teilfonds NN (L) Sovereign Green Bond wurde am 31. März 2021 aufgelegt.
[(2)] Der Teilfonds NN (L) US Growth Equity wurde am 22. September 2021 liquidiert.

Bei den angegebenen Swing-Faktoren handelt es sich um die derzeit geltenden Faktoren und möglichweise nicht um die tatsächlich in dem am 30. September 2021 beendeten Geschäftsjahr angewandten Swing-Faktoren.

## 4- SONSTIGE VERMÖGENSWERTE UND SONSTIGE VERBINDLICHKEITEN

Der Posten „Sonstige Vermögenswerte“ umfasst hauptsächlich aufgelaufene Zinsen, Forderungen aus dem Verkauf von Wertpapieren und anderen Instrumenten, Forderungen aus Zeichnungen, sonstige Forderungen, Bar-Sicherheiten (cash collaterals) von Brokern und Zinsforderungen aus Swaps.

Der Posten „Sonstige Verbindlichkeiten“ enthält vor allem Gebührenrückstellungen, Verbindlichkeiten aus dem Kauf von Wertpapieren und anderen Instrumenten, Verbindlichkeiten aus Rücknahmen, sonstige Verbindlichkeiten, an Broker zu leistende Bar-Sicherheiten (cash collaterals), für Swapgeschäfte zu entrichtende Zinsen und Rückstellungen für Verwässerungs-Swing-downs.

## 5- VERWALTUNGSGEBÜHREN

Die Teilfonds zahlen gemäß dem zwischen NN Investment Partners B.V. und der SICAV geschlossenen „Gesamtportfolioverwaltungsvertrag“ und den darin festgelegten Bedingungen eine jährliche Verwaltungsgebühr an NN Investment Partners B.V., die auf der Grundlage des durchschnittlichen Nettovermögens der jeweiligen Anteilsklasse gemäß nachstehender Tabelle berechnet wird. Sie ist monatlich rückwirkend zahlbar.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Zum 30. September 2021 galten folgende Sätze für die effektive Verwaltungsgebühr der aktiven Anteilsklassen:

| Teilfonds | Verwaltungsgebühren (p.a.) | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Klasse D (in %) | Klasse I (in %) | Klasse M (in %) | Klasse N (in %) | Klasse O (in %) | Klasse P (in %) | Klasse Q (in %) | Klasse R (in %) | Klasse S (in %) | Klasse T (in %) | Klasse U (in %) | Klasse V (in %) | Klasse X (in %) | Klasse Y (in %) | Klasse Z* (in %) | Klasse Zz* (in %) |
| NN (L) AAA ABS | - | 0,12 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) Alternative Beta | - | 0,50 | - | 0,50 | - | 1,00 | - | 0,50 | - | - | - | - | 1,30 | - | - | 0,00 |
| NN (L) Asia Income | - | 0,60 | - | 0,65 | 0,45 | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | 2,00 | - | - |
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | - | 0,72 | - | 0,50 | 0,30 | 1,00 | - | 0,60 | - | - | 0,39 | - | 1,50 | 1,50 | 0,00 | - |
| NN (L) Asian High Yield | - | 0,72 | - | - | - | 1,00 | - | - | - | - | 0,39 | - | - | - | - | - |
| NN (L) Banking & Insurance | - | 0,60 | - | - | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | - | - | - |
| NN (L) Belgian Government Bond | - | - | - | - | - | 0,60 | - | 0,36 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| NN (L) Climate & Environment | - | 0,60 | - | 0,58 | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | 2,00 | - | - |
| NN (L) Commodity Enhanced | - | 0,50 | - | 0,50 | 0,30 | 1,00 | - | - | - | - | - | - | 1,30 | - | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) Corporate Green Bond | - | 0,20 | - | - | - | - | - | 0,20 | - | - | - | - | 0,75 | - | - | - |
| NN (L) Emerging Europe Equity | - | 0,65 | - | - | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | - | - | - |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | - | 0,72 | - | 0,60 | - | 1,20 | - | - | - | - | - | - | 1,50 | - | 0,00 | - |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | - | 0,72 | - | 0,60 | 0,36 | 1,20 | - | 0,72 | - | - | - | - | 1,50 | 1,50 | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond) | - | 0,72 | - | 0,50 | - | 1,00 | - | 0,72 | - | - | - | - | 1,50 | - | - | 0,00 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency) | - | 0,72 | - | 0,50 | - | 1,00 | - | 0,72 | - | - | - | - | 1,50 | - | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency) | - | 0,50 | - | - | - | 1,00 | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,00 | - |
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity | - | 0,10 | - | 0,10 | - | 0,35 | - | 0,10 | - | - | - | - | 0,85 | 0,85 | 0,00 | - |
| NN (L) Emerging Markets High Dividend | - | 0,60 | - | 0,65 | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | 2,00 | - | 0,00 |
| NN (L) Energy | - | 0,60 | - | - | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | 2,00 | - | - |
| NN (L) Euro Covered Bond | - | 0,24 | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) Euro Credit | - | 0,36 | - | - | - | 0,75 | 0,25 | 0,36 | - | - | - | 0,75 | 1,00 | - | 0,00 | - |
| NN (L) EURO Equity | - | 0,48 | - | - | - | 1,30 | - | 0,65 | - | - | - | 1,30 | 1,80 | - | - | - |
| NN (L) Euro Fixed Income | - | 0,36 | - | 0,35 | 0,20 | 0,65 | - | 0,36 | - | - | - | 0,65 | 0,75 | - | 0,00 | - |
| NN (L) Euro High Dividend | - | 0,60 | - | 0,60 | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | 0,48 | 1,50 | 2,00 | 2,00 | - | - |
| NN (L) Euro Income | - | - | - | - | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | - | - | - |
| NN (L) Euro Liquidity | - | 0,01 | - | 0,01 | - | 0,01 | - | 0,01 | 0,01 | - | - | - | 0,01 | - | - | - |
| NN (L) Euro Long Duration Bond | - | 0,36 | - | 0,20 | - | 0,65 | - | - | - | - | - | - | 0,75 | - | - | - |
| NN (L) Euro Short Duration | - | 0,36 | - | - | - | 0,60 | - | 0,36 | - | - | - | - | - | - | 0,00 | - |
| NN (L) Euro Sustainable Credit | - | 0,36 | - | 0,23 | - | 0,65 | - | 0,36 | - | 0,19 | - | - | 0,75 | - | 0,00 | - |
| NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials) | - | 0,36 | - | 0,23 | 0,20 | 0,65 | - | 0,36 | - | - | - | - | 0,75 | - | - | - |
| NN (L) Euromix Bond | - | 0,36 | - | 0,25 | - | 0,65 | - | 0,36 | - | - | - | 0,65 | 0,75 | - | - | - |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Verwaltungsgebühren (p.a.) | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Klasse D (in %) | Klasse I (in %) | Klasse M (in %) | Klasse N (in %) | Klasse O (in %) | Klasse P (in %) | Klasse Q (in %) | Klasse R (in %) | Klasse S (in %) | Klasse T (in %) | Klasse U (in %) | Klasse V (in %) | Klasse X (in %) | Klasse Y (in %) | Klasse Z* (in %) | Klasse Zz* (in %) |
| NN (L) European ABS | - | 0,36 | - | 0,15 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,00 | - |
| NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity | - | 0,08 | - | - | - | 0,35 | - | 0,10 | - | - | - | - | 0,85 | - | 0,00 | - |
| NN (L) European Equity | - | 0,48 | - | 0,65 | 0,39 | 1,30 | - | 0,65 | - | - | - | - | 1,80 | - | 0,00 | - |
| NN (L) European High Dividend | - | 0,60 | - | 0,60 | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | 1,50 | 2,00 | - | - | - |
| NN (L) European High Yield | - | 0,72 | - | 0,50 | - | 1,00 | - | 0,60 | 0,72 | - | - | - | 1,50 | - | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) European Participation Equity | - | 0,60 | - | - | - | 1,50 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| NN (L) European Real Estate | - | 0,48 | - | 0,65 | - | 1,30 | - | 0,65 | - | - | - | - | 1,80 | - | - | - |
| NN (L) European Sustainable Equity | - | 0,60 | - | 0,65 | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | - | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) First Class Multi Asset | - | 0,50 | - | 0,50 | 0,30 | 1,00 | - | 0,50 | - | - | - | - | 1,50 | 1,50 | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) First Class Multi Asset Premium | - | 0,60 | - | 0,60 | - | 1,20 | - | - | - | - | - | - | 2,00 | - | 0,00 | - |
| NN (L) First Class Protection | - | 0,36 | - | 0,36 | - | 0,72 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| NN (L) First Class Stable Yield Opportunities | 0,45 | 0,30 | - | 0,25 | - | 0,45 | - | - | - | - | - | - | 0,75 | - | 0,00 | - |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | - | 0,60 | - | 0,45 | - | 0,90 | - | - | - | - | - | - | 1,20 | 1,20 | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) Food & Beverages | - | 0,60 | - | - | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | 2,00 | - | - |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | - | 0,72 | - | 0,60 | - | 1,20 | - | - | - | - | - | - | 1,50 | 1,50 | - | - |
| NN (L) Global Bond Opportunities | - | 0,36 | - | 0,35 | - | 0,75 | - | 0,36 | - | - | - | - | 1,00 | - | - | - |
| NN (L) Global Convertible Bond[(1)] | - | 0,50 | - | - | - | 0,8 | - | 0,50 | - | - | - | - | - | - | 0,00 | - |
| NN (L) Global Convertible Opportunities | - | 0,72 | - | 0,50 | - | 1,20 | - | 0,60 | - | - | - | - | 1,50 | - | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity | - | 0,08 | - | - | - | 0,35 | - | 0,10 | - | - | - | - | 0,85 | - | 0,00 | - |
| NN (L) Global Equity Impact Opportunities | - | 0,60 | 1,18 | 0,30 | 0,30 | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | - | - | - |
| NN (L) Global High Dividend | - | 0,60 | - | - | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | 2,00 | - | - |
| NN (L) Global High Yield | - | 0,72 | - | 0,50 | - | 1,00 | - | 0,60 | - | - | - | - | 1,50 | 1,50 | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) Global Inflation Linked Bond | - | 0,36 | - | 0,35 | - | 0,65 | - | 0,36 | - | - | - | - | 0,75 | - | - | - |
| NN (L) Global Investment Grade Credit | - | 0,36 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,00 |
| NN (L) Global Real Estate | - | 0,48 | 1,09 | - | - | 1,30 | - | 0,65 | - | - | - | - | 1,80 | - | - | 0,00 |
| NN (L) Global Sustainable Equity | - | 0,60 | 1,08 | 0,43 | 0,43 | 1,50 | - | 0,75 | - | 0,49 | - | 1,50 | 2,00 | - | 0,00 | 0,00 |
| NN (L) Greater China Equity | - | 0,60 | - | 0,65 | 0,45 | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | 2,00 | 0,00 | - |
| NN (L) Green Bond | - | 0,20 | - | 0,20 | - | 0,40 | - | 0,20 | - | 0,14 | - | - | 0,75 | - | 0,00 | - |
| NN (L) Green Bond Short Duration | - | 0,20 | - | - | - | 0,40 | - | 0,20 | - | - | - | - | 0,75 | - | - | - |
| NN (L) Health & Well-being | - | 0,60 | - | 0,58 | 0,35 | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | - | - | - |
| NN (L) Health Care | - | 0,60 | - | - | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | - | - | - |
| NN (L) Japan Equity | - | 0,60 | - | - | - | 1,30 | - | 0,65 | - | - | - | 1,30 | 1,80 | 1,80 | 0,00 | - |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Verwaltungsgebühren (p.a.) | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Klasse D (in %) | Klasse I (in %) | Klasse M (in %) | Klasse N (in %) | Klasse O (in %) | Klasse P (in %) | Klasse Q (in %) | Klasse R (in %) | Klasse S (in %) | Klasse T (in %) | Klasse U (in %) | Klasse V (in %) | Klasse X (in %) | Klasse Y (in %) | Klasse Z* (in %) | Klasse Zz* (in %) |
| NN (L) Multi Asset Factor Opportunities | - | 0,60 | - | - | - | 1,20 | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,00 | - |
| NN (L) Multi Asset High Income | - | 0,60 | - | - | - | 1,20 | - | - | - | - | - | - | 2,00 | - | 0,00 | - |
| NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity | - | 0,08 | - | - | - | 0,35 | 0,03 | 0,10 | - | - | - | - | 0,85 | - | 0,00 | - |
| NN (L) Smart Connectivity | - | 0,60 | - | 0,58 | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | - | - | - |
| NN (L) Sovereign Green Bond[(2)] | - | 0,20 | - | - | - | 0,40 | - | 0,20 | - | - | - | - | 0,75 | - | 0,00 | - |
| NN (L) US Behavioural Equity[(3)] | - | 0,60 | - | - | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | - | - | 0,00 | - |
| NN (L) US Credit | - | 0,36 | - | 0,35 | - | 0,75 | - | 0,36 | - | - | - | - | 1,00 | 1,00 | 0,00 | - |
| NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity | - | 0,48 | - | - | - | 1,30 | - | 0,65 | - | - | - | 1,30 | 1,80 | - | - | - |
| NN (L) US Factor Credit | - | 0,36 | - | 0,36 | - | 0,65 | - | - | - | - | - | - | 0,75 | - | - | - |
| NN (L) US Growth Equity[(4)] | - | 0,60 | - | 0,60 | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | - | - | - |
| NN (L) US High Dividend | - | 0,60 | - | 0,15 | - | 1,50 | - | 0,75 | - | - | - | - | 2,00 | 2,00 | - | - |
| NN (L) US High Yield | - | 0,72 | - | - | - | 1,00 | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,00 | 0,00 |

* Bei dieser Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr nicht der Anteilsklasse berechnet. Stattdessen wird durch die Verwaltungsgesellschaft eine spezielle Verwaltungsgebühr erhoben und direkt von den Anteilsinhabern eingezogen.

[(1)] Beim Teilfonds NN (L) Global Convertible Bond gab es folgende Änderung der Verwaltungsgebühr:
- Anteilsklasse „I“: 0,72% bis 31. Dezember 2020 und 0,50% seit 1. Januar 2021,
- Anteilsklasse „P“: 1,20% bis 31. Dezember 2020 und 0,80% seit 1. Januar 2021,
- Anteilsklasse „R“: 0,60% bis 31. Dezember 2020 und 0,50% seit 1. Januar 2021.

[(2)] Der Teilfonds NN (L) Sovereign Green Bond wurde am 31. März 2021 aufgelegt.
[(3)] Der Teilfonds NN (L) US Behavioural Equity wurde am 10. Mai 2021 aufgelegt.
[(4)] Der Teilfonds NN (L) US Growth Equity wurde am 22. September 2021 liquidiert.

Wenn bei Anlagen in OGAW und andere Ziel-OGA die Verwaltungsgesellschaft oder der beauftragte Anlageverwalter direkt aus dem Vermögen dieser OGAW oder anderen OGA eine Verwaltungsgebühr erhält, werden diese Zahlungen von der Vergütung der Verwaltungsgesellschaft oder des beauftragten Anlageverwalters abgezogen.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Der Teilfonds NN (L) Multi Asset High Income hat über 50% seines jeweiligen Nettovermögens in andere OGAW/OGA investiert, die direkt oder im Auftrag derselben Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden. Der maximale Prozentsatz der Verwaltungsgebühr, die von diesen Teilfonds und den OGAW/OGA, in die sie investiert haben, erhoben wird, ist in folgender Tabelle aufgeführt:

| Teilfonds | Verwaltungsgebühr % |
|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt - Z Cap USD* | - |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) - I Cap USD | 0,72 |
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity - I Cap EUR | 0,10 |
| NN (L) European ABS - I Cap EUR | 0,36 |
| NN (L) European High Dividend - I Cap EUR | 0,60 |
| NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity - I Cap USD | 0,08 |
| NN (L) Global High Yield - I Cap EUR (hedged iii) | 0,72 |
| NN (L) Global Sustainable Equity - I Cap EUR | 0,60 |
| NN (L) US High Yield - Z Cap USD* | - |

* Bei dieser Anteilsklasse wird die Verwaltungsgebühr nicht der Anteilsklasse berechnet. Stattdessen wird durch die Verwaltungsgesellschaft eine spezielle Verwaltungsgebühr erhoben und direkt von den Anteilsinhabern eingezogen.

Wenn die von den investierten Teilfonds gezahlten Verwaltungsgebühren höher sind als die von den Teilfonds der SICAV zu zahlenden Verwaltungsgebühren, wird die Differenz (die „überschüssige Verwaltungsgebühr“) in der Ergebnisrechnung und den Veränderungen des Nettovermögens unter „Sonstige Erträge“ ausgewiesen.

NN Investment Partners B.V. hat auf eigene Kosten die nachstehenden Anlageverwalter mit der Verwaltung der verschiedenen Teilfonds betraut:

| Teilfonds | Anlageverwalter |
|---|---|
| NN (L) Asia Income | Nomura Asset Management Taiwan Ltd. |
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | NN Investment Partners (Singapore) Ltd. |
| NN (L) Asian High Yield | NN Investment Partners (Singapore) Ltd. |
| NN (L) Emerging Europe Equity | NN Investment Partners Towarzystwo Funduszy Inwestycyjnych S.A. |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond) | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency) | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency) | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity | Irish Life Investment Managers Limited |
| NN (L) Euro High Dividend | NNIP Advisors B.V. |
| NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity | Irish Life Investment Managers Limited |
| NN (L) European High Dividend | NNIP Advisors B.V. |
| NN (L) First Class Multi Asset | NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) First Class Multi Asset Premium | NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) First Class Stable Yield Opportunities | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Global Bond Opportunities | NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity | Irish Life Investment Managers Limited |
| NN (L) Global High Dividend | American Century Investment Management Inc. |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Anlageverwalter |
|---|---|
| NN (L) Global High Yield | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Global Investment Grade Credit | NN Investment Partners (Singapore) Ltd.,<br>NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) Greater China Equity | Nomura Asset Management Taiwan Ltd. |
| NN (L) Japan Equity | Nomura Asset Management Co. Ltd. |
| NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity | Irish Life Investment Managers Limited |
| NN (L) US Credit | Voya Investment Management Co. LLC. |
| NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity | Voya Investment Management Co. LLC. |
| NN (L) US Factor Credit | NN Investment Partners North America LLC. |
| NN (L) US Growth Equity[(1)] | Voya Investment Management Co. LLC. |
| NN (L) US High Dividend | American Century Investment Management Inc. |
| NN (L) US High Yield | NN Investment Partners North America LLC. |

[(1)] Der Teilfonds NN (L) US Growth Equity wurde am 22. September 2021 liquidiert.

## 6- FESTE SERVICEGEBÜHR

Für jeden Teilfonds wird auf Ebene der Anteilsklassen eine feste Servicegebühr berechnet. Diese Gebühr wird an die Verwaltungsgesellschaft entrichtet, die damit im Namen der Gesellschaft Kosten für die Verwaltung und Verwahrung von Vermögenswerten, die Transferstellengebühr, die belgische Zeichnungsgebühr sowie sonstige laufende Betriebs- und Verwaltungskosten, die der Gesellschaft entstehen, begleicht.

Die feste Servicegebühr ist in dem Sinne fest, dass die Verwaltungsgesellschaft die über die jährlich gezahlte feste Servicegebühr hinausgehenden Aufwendungen für jede Anteilsklasse der einzelnen Teilfonds trägt.

Umgekehrt ist die Verwaltungsgesellschaft berechtigt, den über die tatsächlichen Aufwendungen der jeweiligen Anteilsklasse hinausgehenden Betrag der Servicegebühr einzubehalten, die der jeweiligen Anteilsklasse in Rechnung gestellt wurde.

Die auf Basis des durchschnittlichen Nettovermögens jeder Anteilsklasse berechnete Gebühr ist monatlich rückwirkend zahlbar.
Zum 30. September 2021 galten folgende Sätze für die effektiven festen Servicegebühren der aktiven Anteilsklassen:

| Teilfonds | Feste Servicegebühr (p.a.) | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Klasse D (in %) | Klasse I (in %) | Klasse M (in %) | Klasse N (in %) | Klasse O (in %) | Klasse P (in %) | Klasse Q (in %) | Klasse R (in %) | Klasse S (in %) | Klasse T (in %) | Klasse U (in %) | Klasse V (in %) | Klasse X (in %) | Klasse Y* (in %) | Klasse Z** (in %) | Klasse Zz** (in %) |
| NN (L) AAA ABS | - | 0,12 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,05 | 0,00 |
| NN (L) Alternative Beta | - | 0,20 | - | 0,30 | - | 0,30 | - | 0,30 | - | - | - | - | 0,30 | - | - | 0,00 |
| NN (L) Asia Income | - | 0,25 | - | 0,35 | 0,35 | 0,35 | - | 0,35 | - | - | - | - | 0,35 | 0,35 | - | - |
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | - | 0,15 | - | 0,25 | 0,25 | 0,25 | - | 0,25 | - | - | 0,15 | - | 0,25 | 0,25 | 0,15 | - |
| NN (L) Asian High Yield | - | 0,15 | - | - | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,15 | - | - | - | - | - |
| NN (L) Banking & Insurance | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) Belgian Government Bond | - | - | - | - | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | - | - | - | - |
| NN (L) Climate & Environment | - | 0,20 | - | 0,20 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | 0,25 | - | - |
| NN (L) Commodity Enhanced | - | 0,20 | - | 0,30 | 0,30 | 0,30 | - | - | - | - | - | - | 0,30 | - | 0,20 | 0,00 |
| NN (L) Corporate Green Bond | - | 0,12 | - | - | - | - | - | 0,15 | - | - | - | - | 0,15 | - | - | - |
| NN (L) Emerging Europe Equity | - | 0,25 | - | - | - | 0,35 | - | 0,35 | - | - | - | - | 0,35 | - | - | - |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Feste Servicegebühr (p.a.) | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Klasse D (in %) | Klasse I (in %) | Klasse M (in %) | Klasse N (in %) | Klasse O (in %) | Klasse P (in %) | Klasse Q (in %) | Klasse R (in %) | Klasse S (in %) | Klasse T (in %) | Klasse U (in %) | Klasse V (in %) | Klasse X (in %) | Klasse Y* (in %) | Klasse Z** (in %) | Klasse Zz** (in %) |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | - | 0,15 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | 0,25 | - | 0,15 | - |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | - | 0,15 | - | 0,25 | 0,25 | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | 0,25 | 0,08 | 0,00 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond) | - | 0,15 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | - | 0,00 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency) | - | 0,15 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | 0,08 | 0,00 |
| NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency) | - | 0,15 | - | - | - | 0,20 | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,15 | - |
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity | - | 0,15 | - | 0,20 | - | 0,20 | - | 0,20 | - | - | - | - | 0,20 | 0,20 | 0,15 | - |
| NN (L) Emerging Markets High Dividend | - | 0,25 | - | 0,35 | - | 0,35 | - | 0,35 | - | - | - | - | 0,35 | 0,35 | - | 0,00 |
| NN (L) Energy | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | 0,25 | - | - |
| NN (L) Euro Covered Bond | - | 0,12 | - | 0,15 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,065 | 0,00 |
| NN (L) Euro Credit | - | 0,12 | - | - | - | 0,15 | 0,12 | 0,15 | - | - | - | 0,12 | 0,15 | - | 0,12 | - |
| NN (L) EURO Equity | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | 0,20 | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) Euro Fixed Income | - | 0,12 | - | 0,15 | 0,15 | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | 0,12 | 0,15 | - | 0,12 | - |
| NN (L) Euro High Dividend | - | 0,20 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | 0,20 | 0,20 | 0,25 | 0,25 | - | - |
| NN (L) Euro Income | - | - | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) Euro Liquidity | - | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | 0,15 | 0,12 | - | - | - | 0,15 | - | - | - |
| NN (L) Euro Long Duration Bond | - | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | - | - | 0,15 | - | - | - |
| NN (L) Euro Short Duration | - | 0,12 | - | - | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | - | - | 0,12 | - |
| NN (L) Euro Sustainable Credit | - | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | 0,12 | - | - | 0,15 | - | 0,12 | - |
| NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials) | - | 0,12 | - | 0,15 | 0,15 | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | 0,15 | - | - | - |
| NN (L) Euromix Bond | - | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | 0,12 | 0,15 | - | - | - |
| NN (L) European ABS | - | 0,12 | - | 0,15 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,05 | - |
| NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity | - | 0,10 | - | - | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | 0,15 | - | 0,10 | - |
| NN (L) European Equity | - | 0,20 | - | 0,25 | 0,25 | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | 0,20 | - |
| NN (L) European High Dividend | - | 0,20 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | 0,20 | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) European High Yield | - | 0,15 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | 0,15 | - | - | - | 0,25 | - | 0,15 | 0,00 |
| NN (L) European Participation Equity | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| NN (L) European Real Estate | - | 0,20 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) European Sustainable Equity | - | 0,20 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | 0,08 | 0,00 |
| NN (L) First Class Multi Asset | - | 0,15 | - | 0,20 | 0,20 | 0,20 | - | 0,20 | - | - | - | - | 0,20 | 0,20 | 0,15 | 0,00 |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Feste Servicegebühr (p.a.) | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Klasse D (in %) | Klasse I (in %) | Klasse M (in %) | Klasse N (in %) | Klasse O (in %) | Klasse P (in %) | Klasse Q (in %) | Klasse R (in %) | Klasse S (in %) | Klasse T (in %) | Klasse U (in %) | Klasse V (in %) | Klasse X (in %) | Klasse Y* (in %) | Klasse Z** (in %) | Klasse Zz** (in %) |
| NN (L) First Class Multi Asset Premium | - | 0,15 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | 0,25 | - | 0,05 | - |
| NN (L) First Class Protection | - | 0,15 | - | 0,20 | - | 0,20 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| NN (L) First Class Stable Yield Opportunities | 0,15 | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | - | - | 0,15 | - | 0,12 | - |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | - | 0,15 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | 0,25 | 0,25 | 0,15 | 0,00 |
| NN (L) Food & Beverages | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | 0,25 | - | - |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | - | 0,15 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | 0,25 | 0,25 | - | - |
| NN (L) Global Bond Opportunities | - | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | 0,15 | - | - | - |
| NN (L) Global Convertible Bond | - | 0,15 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | 0,15 | - |
| NN (L) Global Convertible Opportunities | - | 0,15 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | 0,15 | 0,00 |
| NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity | - | 0,10 | - | - | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | 0,15 | - | 0,10 | - |
| NN (L) Global Equity Impact Opportunities | - | 0,20 | 0,20 | 0,25 | 0,25 | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) Global High Dividend | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | 0,25 | - | - |
| NN (L) Global High Yield | - | 0,15 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | 0,25 | 0,06 | 0,00 |
| NN (L) Global Inflation Linked Bond | - | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | 0,15 | - | - | - |
| NN (L) Global Investment Grade Credit | - | 0,12 | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,00 |
| NN (L) Global Real Estate | - | 0,20 | 0,20 | - | | 0,25 | - | 0,25 | - | | - | - | 0,25 | - | - | 0,00 |
| NN (L) Global Sustainable Equity | - | 0,20 | 0,20 | 0,25 | 0,25 | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,20 | - | 0,20 | 0,25 | - | 0,20 | 0,00 |
| NN (L) Greater China Equity | - | 0,25 | - | 0,35 | 0,35 | 0,35 | - | 0,35 | - | - | - | - | 0,35 | 0,35 | 0,25 | - |
| NN (L) Green Bond | - | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | 0,12 | - | - | 0,15 | - | 0,12 | - |
| NN (L) Green Bond Short Duration | - | 0,12 | - | - | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | 0,15 | - | - | - |
| NN (L) Health & Well-being | - | 0,20 | - | 0,20 | 0,20 | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) Health Care | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) Japan Equity | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | 0,20 | 0,25 | 0,25 | 0,08 | - |
| NN (L) Multi Asset Factor Opportunities | - | 0,20 | - | - | - | 0,30 | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,20 | - |
| NN (L) Multi Asset High Income | - | 0,15 | - | - | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | 0,25 | - | 0,15 | - |
| NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity | - | 0,10 | - | - | - | 0,15 | 0,10 | 0,15 | - | - | - | - | 0,15 | - | 0,10 | - |
| NN (L) Smart Connectivity | - | 0,20 | - | 0,20 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) Sovereign Green Bond[1] | - | 0,12 | - | - | - | 0,15 | - | 0,15/ 0,12 [3] | - | - | - | - | 0,15 | - | 0,12 | - |
| NN (L) US Behavioural Equity[2] | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | 0,20 | - |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Feste Servicegebühr (p.a.) | | | | | | | | | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | Klasse D (in %) | Klasse I (in %) | Klasse M (in %) | Klasse N (in %) | Klasse O (in %) | Klasse P (in %) | Klasse Q (in %) | Klasse R (in %) | Klasse S (in %) | Klasse T (in %) | Klasse U (in %) | Klasse V (in %) | Klasse X (in %) | Klasse Y* (in %) | Klasse Z** (in %) | Klasse Zz** (in %) |
| NN (L) US Credit | - | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | 0,15 | 0,15 | 0,12 | - |
| NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity | - | 0,20 | - | - | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | 0,20 | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) US Factor Credit | - | 0,12 | - | 0,15 | - | 0,15 | - | - | - | - | - | - | 0,15 | - | - | - |
| NN (L) US Growth Equity[(4)] | - | 0,20 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | - | - | - |
| NN (L) US High Dividend | - | 0,20 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | 0,25 | - | - | - | - | 0,25 | 0,25 | - | - |
| NN (L) US High Yield | - | 0,15 | - | - | - | 0,25 | - | - | - | - | - | - | - | - | 0,15 | 0,00 |

* Für diese Anteilsklasse wird eine zusätzliche Vertriebsgebühr von 1,00% p.a. erhoben.
** Für diese Anteilsklasse wird eine Servicegebühr erhoben, durch die die Verwaltungs- und Verwahrungskosten von Vermögenswerten und weitere laufende Betriebs- und Verwaltungskosten beglichen werden.

[(1)] Der Teilfonds NN (L) Sovereign Green Bond wurde am 31. März 2021 aufgelegt.
[(2)] Der Teilfonds NN (L) US Behavioural Equity wurde am 10. Mai 2021 aufgelegt.
[(3)] Bei dieser Anteilsklasse bestehen zwei unterschiedliche feste Servicegebühren: 0,15% für thesaurierende und 0,12% für ausschüttende Anteile.
[(4)] Der Teilfonds NN (L) US Growth Equity wurde am 22. September 2021 liquidiert.

## 7- OVERLAYGEBÜHREN

Die Verwaltungsgesellschaft hat möglicherweise Anspruch auf eine einheitliche Gebühr für ein Anteilsklassen-Overlay von maximal 0,04%, die aus dem Vermögen der betreffenden Anteilsklasse und auf Basis der tatsächlichen Kosten zu zahlen ist . Die Gebühr für ein Anteilsklassen-Overlay fällt bei jeder Berechnung des Nettoinventarwerts an und ist insofern als Höchstgebühr festgelegt, als die Verwaltungsgesellschaft beschließen kann, die der jeweiligen Anteilsklasse in Rechnung gestellte Overlaygebühr zu senken, wenn Skaleneffekte dies zulassen.

Die Overlaygebühr gilt für alle Anteilsklassen mit Währungsabsicherung und Anteilsklassen mit Durationsabsicherung. Im Falle der Anteilsklassen „Z“ und „Zz“ können diese Gebühren in der Sondervereinbarung festgelegt sein und werden von der Verwaltungsgesellschaft direkt vom Anteilsinhaber erhoben und eingezogen und nicht der jeweiligen Anteilsklasse in Rechnung gestellt.

Zum 30. September 2021 betrugen die Overlaygebühren 0,021%.

## 8- TRANSAKTIONSKOSTEN

Die den Teilfonds der SICAV entstandenen Transaktionskosten umfassen Brokerage-Gebühren im Zusammenhang mit dem Kauf bzw. Verkauf übertragbarer Wertpapiere, Geldmarktinstrumente und derivativer Finanzinstrumente (bzw. anderer zulässiger Vermögenswerte, in denen die Teilfonds Transaktionen tätigen) und/oder gegebenenfalls Gebühren aus der Zeichnung/Rückgabe von Anteilen/Aktien von OGAW/OGA.

Im Falle von gegenseitigen Anlagen oder Anlagen in Aktien/Anteilen anderer OGAW und/oder anderer OGA, die direkt oder im Auftrag der Verwaltungsgesellschaft verwaltet werden (die „NNIP-Fonds“), gelten keine Transaktionskosten.

Die Transaktionskosten sind ggf. im Kauf-/Verkaufskurs der Wertpapiere enthalten.

Die nachstehende Tabelle zeigt die den einzelnen Teilfonds im Berichtsjahr zum 30. September 2021 entstandenen Transaktionskosten:

| Teilfonds | Währung | Transaktionskosten | Transaktionskosten - Basispunkte (annualisiert) |
|---|---|---|---|
| NN (L) AAA ABS | EUR | - | - |
| NN (L) Alternative Beta | USD | 59.122,00 | 1,58 |
| NN (L) Asia Income | USD | 637.531,00 | 29,32 |
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | USD | 3.692,00 | 0,06 |
| NN (L) Asian High Yield | USD | - | - |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Währung | Transaktionskosten | Transaktionskosten - Basispunkte (annualisiert) |
|---|---|---|---|
| NN (L) Banking & Insurance | USD | 46.341,47 | 9,57 |
| NN (L) Belgian Government Bond | EUR | 223,00 | 0,08 |
| NN (L) Climate & Environment | EUR | 121.116,22 | 6,20 |
| NN (L) Commodity Enhanced | USD | - | - |
| NN (L) Corporate Green Bond | EUR | 2.777,00 | 0,06 |
| NN (L) Emerging Europe Equity | EUR | 36.995,05 | 9,66 |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | USD | 1.001,00 | 0,07 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | USD | 95.638,00 | 0,14 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond) | USD | 211.547,94 | 4,78 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency) | USD | 7.423,00 | 1,47 |
| NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency) | USD | 153,00 | 0,01 |
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable Equity | USD | 910.692,29 | 16,33 |
| NN (L) Emerging Markets High Dividend | EUR | 585.074,00 | 27,73 |
| NN (L) Energy | USD | 126.969,07 | 10,04 |
| NN (L) Euro Covered Bond | EUR | 111,00 | 0,05 |
| NN (L) Euro Credit | EUR | 11.586,00 | 0,08 |
| NN (L) EURO Equity | EUR | 591.276,77 | 17,29 |
| NN (L) Euro Fixed Income | EUR | 48.705,00 | 0,39 |
| NN (L) Euro High Dividend | EUR | 2.186.123,40 | 31,56 |
| NN (L) Euro Income | EUR | 52.273,11 | 14,26 |
| NN (L) Euro Liquidity | EUR | - | - |
| NN (L) Euro Long Duration Bond | EUR | 23.720,00 | 0,27 |
| NN (L) Euro Short Duration | EUR | 1.685,00 | 0,09 |
| NN (L) Euro Sustainable Credit | EUR | 8.754,00 | 0,08 |
| NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials) | EUR | 3.767,00 | 0,07 |
| NN (L) Euromix Bond | EUR | 3.099,00 | 0,11 |
| NN (L) European ABS | EUR | - | - |
| NN (L) European Enhanced Index Sustainable Equity | EUR | 263.995,14 | 25,89 |
| NN (L) European Equity | EUR | 341.735,47 | 19,34 |
| NN (L) European High Dividend | EUR | 585.976,31 | 27,07 |
| NN (L) European High Yield | EUR | - | - |
| NN (L) European Participation Equity | EUR | 20.797,65 | 34,88 |
| NN (L) European Real Estate | EUR | 601.787,24 | 39,96 |
| NN (L) European Sustainable Equity | EUR | 585.711,33 | 10,25 |
| NN (L) First Class Multi Asset | EUR | 697.325,05 | 8,35 |
| NN (L) First Class Multi Asset Premium | EUR | 160.884,83 | 10,85 |
| NN (L) First Class Protection | EUR | 5.110,00 | 0,78 |
| NN (L) First Class Stable Yield Opportunities | EUR | 981,00 | 0,24 |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | EUR | 13.205,00 | 0,30 |
| NN (L) Food & Beverages | USD | 218.246,46 | 10,65 |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | USD | 4.531,00 | 0,13 |
| NN (L) Global Bond Opportunities | EUR | 17.289,00 | 2,74 |
| NN (L) Global Convertible Bond | USD | 419,00 | 0,04 |
| NN (L) Global Convertible Opportunities | USD | - | - |
| NN (L) Global Enhanced Index Sustainable Equity | USD | 356.726,21 | 5,35 |
| NN (L) Global Equity Impact Opportunities | EUR | 173.490,80 | 3,91 |
| NN (L) Global High Dividend | EUR | 239.052,16 | 5,11 |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Währung | Transaktionskosten | Transaktionskosten - Basispunkte (annualisiert) |
|---|---|---|---|
| NN (L) Global High Yield | EUR | - | - |
| NN (L) Global Inflation Linked Bond | EUR | 11.576,00 | 0,63 |
| NN (L) Global Investment Grade Credit | USD | 4.464,00 | 0,41 |
| NN (L) Global Real Estate | EUR | 269.706,72 | 14,37 |
| NN (L) Global Sustainable Equity | EUR | 721.584,53 | 3,29 |
| NN (L) Greater China Equity | USD | 1.249.677,00 | 38,23 |
| NN (L) Green Bond | EUR | 10.639,00 | 0,08 |
| NN (L) Green Bond Short Duration | EUR | 2.632,00 | 0,18 |
| NN (L) Health & Well-being | EUR | 117.917,67 | 3,96 |
| NN (L) Health Care | USD | 202.884,10 | 5,81 |
| NN (L) Japan Equity | JPY | 19.528.576,00 | 8,63 |
| NN (L) Multi Asset Factor Opportunities | USD | 359.408,00 | 11,48 |
| NN (L) Multi Asset High Income | EUR | 967,00 | 1,78 |
| NN (L) North America Enhanced Index Sustainable Equity | USD | 81.801,25 | 1,36 |
| NN (L) Smart Connectivity | EUR | 263.868,75 | 3,58 |
| NN (L) Sovereign Green Bond[(1)] | EUR | 956,00 | 0,06 |
| NN (L) US Behavioural Equity[(2)] | USD | 18.037,00 | 4,80 |
| NN (L) US Credit | USD | 108.633,00 | 0,30 |
| NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity | USD | 251.168,00 | 5,86 |
| NN (L) US Factor Credit | USD | 676,00 | 0,16 |
| NN (L) US Growth Equity[(3)] | USD | 18.576,00 | 6,11 |
| NN (L) US High Dividend | USD | 38.241,00 | 1,36 |
| NN (L) US High Yield | USD | 263,00 | 0,01 |

[(1)] Der Teilfonds NN (L) Sovereign Green Bond wurde am 31. März 2021 aufgelegt.
[(2)] Der Teilfonds NN (L) US Behavioural Equity wurde am 10. Mai 2021 aufgelegt.
[(3)] Der Teilfonds NN (L) US Growth Equity wurde am 22. September 2021 liquidiert.

## 9- ABONNEMENTSTEUER

Die Gesellschaft unterliegt in Luxemburg einer Abonnementsteuer („Taxe d'abonnement“) von 0,01% p.a. ihres Nettovermögens für sämtliche institutionellen Anlegern vorbehaltenen Anteile sowie alle Anteile des Geldmarktteilfonds NN (L) Euro Liquidity und von 0,05% p.a. für alle anderen Anteile.

Die Abonnementsteuer ist vierteljährlich zu zahlen und wird auf der Grundlage des Nettoinventarwertes am Ende des entsprechenden Quartals berechnet.

Auf Anteile, welche die Gesellschaft in anderen OGAs hält, die dieser Steuer in Luxemburg bereits unterliegen, wird keine Abonnementsteuer gezahlt.

## 10- SONSTIGE ERTRÄGE

Dieses Konto enthält in erster Linie Erträge aus Wertpapierleihgeschäften, Consent Payment-Erträge aus Anleihen und die überschüssigen Verwaltungsgebühren gemäß Erläuterung 5.

## 11- SONSTIGE AUSGABEN

Dieser Posten enthält hauptsächlich Rechtskosten, variable Gebühren für Aktien-Hinterlegungsscheine (ADR und GDR) sowie Kapitalertragssteuern.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

## 12- WERTPAPIER-BESTANDSVERÄNDERUNGEN

Die Auflistung der Bestandsveränderungen steht den Anteilsinhabern bei der Depotbank und am Sitz der Gesellschaft sowie an den Schaltern der in diesem Bericht aufgeführten lokalen Vertriebsstellen oder Hauptansprechpartnern in der Kundenbetreuung zur Verfügung. Darüber hinaus werden sie auf Anfrage kostenlos versandt.

## 13- WERTPAPIERLEIHGESCHÄFTE

Gemäß einer am 26. Februar 2008 getroffenen und am 2. Mai 2011 geänderten Vereinbarung hat die SICAV Goldman Sachs International Bank zum Wertpapierleihbeauftragten der SICAV ernannt.

Die Gesamtheit der aus dem Wertpapierleihprogramm generierten Erträge wird den teilnehmenden Teilfonds gutgeschrieben. Die Gebührenstruktur der Wertpapierleihgeschäfte basiert auf der generierten Rendite sowie den von den Gegenparteien, die Wertpapiere leihen, vereinnahmten Einkünften. NN Investment Partners B.V. und/oder externe Leihbeauftragte berechnen hierfür keine Verwaltungsgebühr.

Zum 30. September 2021 hatten die nachstehend aufgeführten Teilfonds der SICAV Wertpapierleihgeschäfte abgeschlossen.

Der Wert der verliehenen Wertpapiere und der Marktwert der für jeden Teilfonds erhaltenen Sicherheiten sind in nachstehender Tabelle aufgeführt:

| Teilfonds | Währung | Marktwert der verliehenen Wertpapiere | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten* | Erträge aus Wertpapier-leihgeschäften |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | USD | 4.606.308,91 | 5.349.071,34 | 77.291,85 |
| NN (L) Asian High Yield | USD | 4.174.404,92 | 4.412.302,05 | 44.810,93 |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | USD | 1.362.135,54 | 1.528.277,14 | 2.681,42 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | USD | 131.856.689,13 | 149.185.653,50 | 420.561,93 |
| NN (L) EURO Equity | EUR | 3.418.496,00 | 3.805.436,26 | 104.772,21 |
| NN (L) European High Dividend | EUR | 1.009.539,56 | 1.119.547,11 | 19.768,80 |
| NN (L) European High Yield | EUR | 6.572.074,45 | 7.541.189,21 | 28.023,23 |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | EUR | 3.840.526,32 | 4.382.792,86 | 9.962,23 |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | USD | 16.159.502,82 | 18.118.180,43 | 30.158,85 |
| NN (L) Global High Yield | EUR | 74.943.956,24 | 85.204.881,37 | 284.821,82 |
| NN (L) US High Yield | USD | 4.072.261,63 | 4.710.482,91 | 15.761,47 |

* Als Sicherheit werden qualitativ hochwertige Staatsanleihen und Barmittel eingesetzt.

Zum 30. September 2021 waren folgende Unternehmen als Gegenpartei zugelassen: ABN AMRO Bank N.V., Banco Santander SA, Barclays Capital Securities Ltd, BNP Paribas Arbitrage S.N.C., BNP Paribas Prime Brokerage International Ltd. (Ireland), BNP Paribas SA, Citigroup Global Markets Inc., Citigroup Global Markets Ltd, Commerzbank AG, Credit Agricole S.A., Credit Suisse AG (Dublin Branch), Credit Suisse Securities (Europe) Limited, Deutsche Bank AG, Goldman Sachs International, HSBC Bank PLC, ING Bank N.V., JP Morgan Securities Plc, Merrill Lynch International, Morgan Stanley & Co International Plc, Natixis SA, Nomura International Plc, Skandinaviska Enskilda Banken AB., Societe Generale S.A., UBS AG.

Die folgenden Teilfonds vereinnahmten im Berichtszeitraum Erträge aus Wertpapierleihgeschäften, wiesen jedoch zum 30. September 2021 keine Wertpapierleihe auf:

| Teilfonds | Währung | Erträge aus Wertpapierleihgeschäften |
|---|---|---|
| NN (L) Asia Income | USD | 2.351,79 |
| NN (L) Emerging Europe Equity | EUR | 8.942,75 |
| NN (L) Euro Income | EUR | 11.663,60 |
| NN (L) European Equity | EUR | 35.490,70 |
| NN (L) Global High Dividend | EUR | 25.689,07 |
| NN (L) Greater China Equity | USD | 203.482,46 |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

Die Erträge aus Wertpapierleihgeschäften sind im Posten „Sonstige Erträge“ enthalten.

## 14- INFORMATION FÜR DIE ANTEILSINHABER

Gemäß dem belgischen Programmgesetz vom 22. Dezember 2003, das am 1. Januar 2004 in Kraft trat, ist auf den Anteil belgischer Anleger am Fondsvermögen, der am 31. Dezember des vorangehenden Berichtsjahres investiert war, eine Steuer von 0,06% p.a. zu zahlen. Die Steuer wurde 2005 auf 0,07% p.a., 2007 auf 0,08% p.a., 2013 auf 0,0965% erhöht. Ab 2014 wurde sie auf 0,0925% gesenkt.

Die Gesellschaft hat bei der Europäischen Kommission eine Beschwerde gegen den belgischen Staat eingereicht, um die Unvereinbarkeit dieser Steuer mit dem Gemeinschaftsrecht feststellen zu lassen. Die Europäische Kommission hat diese Beschwerde zurückgewiesen. Die Gesellschaft hat in Belgien eine weitere Beschwerde eingereicht. Das Brüsseler Gericht erster Instanz hat den belgischen Staat daraufhin zur Erstattung der rechtsgrundlos geleisteten Zahlungen verurteilt. Der belgische Staat legte Rechtsmittel gegen das Urteil ein. Das Brüsseler Appelationsgericht verkündete am 29. November 2018 sein Urteil. Das erstinstanzliche Urteil wurde bestätigt, das den belgischen Staat zur Erstattung der jährlich vom Luxemburger Fonds erhobenen belgischen Steuer verurteilte. Der belgische Staat legte beim obersten Gerichtshof Belgiens Rechtsmittel gegen das Urteil des Appelationsgerichts ein. Das Verfahren beim obersten Gerichtshof ist noch anhängig.

## 15- SICHERHEITEN IM ZUSAMMENHANG MIT AUSSERBÖRSLICH GEHANDELTEN DERIVATIVEN FINANZINSTRUMENTEN

Zur Reduzierung des Gegenparteirisikos im Zusammenhang mit außerbörslich gehandelten derivativen Finanzinstrumenten hat die Gesellschaft von den unten aufgeführten Gegenparteien Sicherheiten (*Collaterals*) erhalten bzw. diesen Sicherheiten gestellt.

Zum 30. September 2021 belief sich der Wert der erhaltenen/(gestellten) Sicherheiten auf folgende Beträge:

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) AAA ABS | Barclays | Barmittel | EUR | 1.240.000,00 |
| | | | **Gesamt** | **1.240.000,00** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Alternative Beta | Goldman Sachs | Barmittel | USD | 920.000,00 |
| | State Street Bank | Barmittel | USD | (7.959.999,99) |
| | | | **Gesamt** | **(7.039.999,99)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Asia Income | Bank of America | Barmittel | USD | (20.000,00) |
| | BNP Paribas | Barmittel | USD | (280.000,00) |
| | Goldman Sachs | Barmittel | USD | (290.000,00) |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | USD | (80.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(670.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | USD | 70.000,00 |
| | State Street Bank | Barmittel | USD | (3.040.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(2.970.000,00)** |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Asian High Yield | State Street Bank | Barmittel | USD | (1.020.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(1.020.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Commodity Enhanced | Goldman Sachs | Barmittel | USD | 2.680.000,00 |
| | Société Générale | Barmittel | USD | 2.920.000,00 |
| | State Street Bank | Barmittel | USD | (7.300.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(1.700.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | State Street Bank | Barmittel | USD | (270.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(270.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | Bank of America | Barmittel | USD | 2.360.000,00 |
| | Barclays | Barmittel | USD | 11.410.000,00 |
| | BNP Paribas | Barmittel | USD | 980.000,00 |
| | Citigroup | Barmittel | USD | 3.963.180,00 |
| | Goldman Sachs | Barmittel | USD | 4.120.000,00 |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | USD | 16.251.000,00 |
| | Morgan Stanley | Barmittel | USD | 9.360.000,00 |
| | Nomura International PLC | Barmittel | USD | (1.350.000,00) |
| | Société Générale | Barmittel | USD | 1.650.000,00 |
| | State Street Bank | Barmittel | USD | (146.310.000,01) |
| | | | **Gesamt** | **(97.565.820,01)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond) | Bank of America | Barmittel | USD | (270.000,00) |
| | Citigroup | Barmittel | USD | 240.000,00 |
| | HSBC | Barmittel | USD | 20.000,00 |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | USD | (270.000,00) |
| | Morgan Stanley | Barmittel | USD | (30.000,00) |
| | Société Générale | Barmittel | USD | (540.000,00) |
| | State Street Bank | Barmittel | USD | (1.200.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(2.050.000,00)** |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency) | State Street Bank | Barmittel | USD | (280.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(280.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency) | Citigroup | Barmittel | USD | 30.000,00 |
| | Goldman Sachs | Barmittel | USD | 110.000,00 |
| | | | **Gesamt** | **140.000,00** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Enhanced Index Sustainable | State Street Bank | Barmittel | USD | (1.640.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(1.640.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets High Dividend | State Street Bank | Barmittel | EUR | (477.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(477.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Euro Credit | BNP Paribas | Barmittel | EUR | 210.000,00 |
| | Citigroup | Barmittel | EUR | (50.000,00) |
| | Goldman Sachs | Barmittel | EUR | 410.000,00 |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | EUR | 150.000,00 |
| | Société Générale | Barmittel | EUR | (30.000,00) |
| | UBS AG | Barmittel | EUR | (870.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(180.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Euro Fixed Income | Bank of America | Barmittel | EUR | 810.000,00 |
| | Bank of New York Mellon | Barmittel | EUR | 1.250.000,00 |
| | BNP Paribas | Barmittel | EUR | 3.400.000,00 |
| | Citigroup | Barmittel | EUR | (160.000,00) |
| | Goldman Sachs | Barmittel | EUR | 550.000,00 |
| | HSBC Bank Plc | Barmittel | EUR | 630.000,00 |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | EUR | 480.000,00 |
| | Morgan Stanley | Barmittel | EUR | 760.000,00 |
| | | | **Gesamt** | **7.720.000,00** |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Euro High Dividend | State Street Bank | Barmittel | EUR | 906.000,00 |
| | | | **Gesamt** | **906.000,00** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Euro Long Duration Bond | BNP Paribas | Barmittel | EUR | (290.000,00) |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | EUR | (10.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(300.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Euro Sustainable Credit | BNP Paribas | Barmittel | EUR | 260.000,00 |
| | Citigroup | Barmittel | EUR | (30.000,00) |
| | Société Générale | Barmittel | EUR | (40.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **190.000,00** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials) | BNP Paribas | Barmittel | EUR | 120.000,00 |
| | Deutsche Bank | Barmittel | EUR | (150.000,00) |
| | Société Générale | Barmittel | EUR | (10.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(40.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) European ABS | Barclays | Barmittel | EUR | 330.000,00 |
| | Morgan Stanley | Barmittel | EUR | 160.000,00 |
| | | | **Gesamt** | **490.000,00** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) European High Dividend | State Street Bank | Barmittel | EUR | (519.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(519.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) European High Yield | Bank of America | Barmittel | EUR | (260.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(260.000,00)** |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) First Class Multi Asset | Bank of America | Barmittel | EUR | (740.000,02) |
| | Barclays | Barmittel | EUR | (270.000,00) |
| | BNP Paribas | Barmittel | EUR | (490.000,00) |
| | Deutsche Bank | Barmittel | EUR | 10.000,00 |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | EUR | (1.729.999,98) |
| | Morgan Stanley | Barmittel | EUR | (10.000,00) |
| | Société Générale | Barmittel | EUR | (1.700.000,00) |
| | State Street Bank | Barmittel | EUR | (898.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(5.828.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) First Class Multi Asset Premium | Bank of America | Barmittel | EUR | (220.000,01) |
| | Barclays | Barmittel | EUR | (370.000,00) |
| | Deutsche Bank | Barmittel | EUR | (480.000,00) |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | EUR | (440.000,01) |
| | Morgan Stanley | Barmittel | EUR | (160.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(1.670.000,02)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) First Class Stable Yield Opportunities | Bank of America | Barmittel | EUR | (260.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(260.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) First Class Yield Opportunities | Bank of America | Barmittel | EUR | (8.500.000,05) |
| | Citigroup | Barmittel | EUR | (10.000,00) |
| | HSBC Bank Plc | Barmittel | EUR | 10.000,00 |
| | Morgan Stanley | Barmittel | EUR | (20.000,00) |
| | Société Générale | Barmittel | EUR | (50.000,00) |
| | State Street Bank | Barmittel | EUR | (578.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(9.148.000,05)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Food & Beverages | State Street Bank | Barmittel | USD | (590.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(590.000,00)** |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | USD | 560.000,00 |
| | State Street Bank | Barmittel | USD | (1.810.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(1.250.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Global Bond Opportunities | Bank of America | Barmittel | EUR | 510.000,00 |
| | BNP Paribas | Barmittel | EUR | 450.000,00 |
| | Citigroup | Barmittel | EUR | 30.000,00 |
| | Goldman Sachs | Barmittel | EUR | 290.000,00 |
| | HSBC Bank Plc | Barmittel | EUR | 10.000,00 |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | EUR | 780.000,00 |
| | Morgan Stanley | Barmittel | EUR | 70.000,00 |
| | State Street Bank | Barmittel | EUR | (572.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **1.568.000,00** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/(gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Global Convertible Bond | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | USD | 630.000,00 |
| | | | **Gesamt** | **630.000,00** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Global Convertible Opportunities | Bank of America | Barmittel | USD | 20.000,00 |
| | BNP Paribas | Barmittel | USD | (19.999,99) |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | USD | 7.320.000,00 |
| | Morgan Stanley | Barmittel | USD | (130.000,00) |
| | State Street Bank | Barmittel | USD | (19.639.999,99) |
| | | | **Gesamt** | **(12.449.999,98)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Global Equity Impact Opportunities | State Street Bank | Barmittel | EUR | (1.821.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(1.821.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Global High Dividend | State Street Bank | Barmittel | EUR | (3.255.000,01) |
| | | | **Gesamt** | **(3.255.000,01)** |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Global High Yield | Bank of America | Barmittel | EUR | 260.000,00 |
| | Barclays | Barmittel | EUR | (290.000,00) |
| | BNP Paribas | Barmittel | EUR | (1.740.000,00) |
| | Société Générale | Barmittel | EUR | 10.000,00 |
| | State Street Bank | Barmittel | EUR | (24.474.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(26.234.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Global Inflation Linked Bond | Deutsche Bank | Barmittel | EUR | 510.000,00 |
| | State Street Bank | Barmittel | EUR | (1.356.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(846.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Global Sustainable Equity | State Street Bank | Barmittel | EUR | (704.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(704.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Green Bond | Deutsche Bank | Barmittel | EUR | (850.000,00) |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | EUR | (150.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(1.000.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Green Bond Short Duration | State Street Bank | Barmittel | EUR | 547.000,00 |
| | | | **Gesamt** | **547.000,00** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Health Care | State Street Bank | Barmittel | USD | (2.640.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(2.640.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Japan Equity | State Street Bank | Barmittel | JPY | (106.099.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(106.099.000,00)** |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Multi Asset Factor Opportunities | Bank of America | Barmittel | USD | (500.000,00) |
| | Barclays | Barmittel | USD | 1.880.000,00 |
| | BNP Paribas | Barmittel | USD | 1.560.000,00 |
| | HSBC Bank Plc | Barmittel | USD | (880.000,00) |
| | JP Morgan Chase Bank | Barmittel | USD | (640.000,00) |
| | Morgan Stanley | Barmittel | USD | 360.000,00 |
| | Société Générale | Barmittel | USD | (15.630.000,30) |
| | State Street Bank | Barmittel | USD | (7.200.000,01) |
| | | | **Gesamt** | **(21.050.000,31)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Smart Connectivity | State Street Bank | Barmittel | EUR | (232.969,50) |
| | | | **Gesamt** | **(232.969,50)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) US Credit | State Street Bank | Barmittel | USD | (24.320.000,01) |
| | | | **Gesamt** | **(24.320.000,01)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) US Enhanced Core Concentrated Equity | State Street Bank | Barmittel | USD | (1.360.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(1.360.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) US High Dividend | State Street Bank | Barmittel | USD | (2.760.000,00) |
| | | | **Gesamt** | **(2.760.000,00)** |

| Teilfonds | Gegenpartei | Art der Sicherheiten | Währung | Erhaltene/ (gestellte) Sicherheiten gesamt |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) US High Yield | Bank of America | Barmittel | USD | 320.000,00 |
| | | | **Gesamt** | **320.000,00** |

Die gestellten Barsicherheiten sind im Posten „Sonstige Vermögenswerte“ enthalten.
Die erhaltenen Barsicherheiten sind im Posten „Sonstige Verbindlichkeiten“ enthalten.

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

## 16- VERORDNUNG ÜBER WERTPAPIERFINANZIERUNGSGESCHÄFTE

Die Verordnung über Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTR“) führt im Rahmen der Transparenz von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und der Weiterverwendung Berichtspflichten für Wertpapierfinanzierungsgeschäfte („SFTs“) und Gesamtrendite-Swaps (Total Return Swaps) ein.

Ein Wertpapierfinanzierungsgeschäft (SFT) ist gemäß Artikel 3 Absatz 11 der SFTR definiert als:
- ein Pensionsgeschäft (Repo- oder Reverse Repo-Geschäft);
- ein Wertpapier- oder Warenleihgeschäft;
- ein Kauf-/Rückverkaufgeschäft oder ein Verkauf-/Rückkaufgeschäft;
- ein Lombardgeschäft.

Per 30. September 2021 bestanden folgende Arten von Wertpapierfinanzierungsgeschäften gemäß SFTR bei den Teilfonds: Wertpapierleihgeschäfte und Total Return Swaps.

**Allgemeine Angaben**

Der Betrag der Vermögenswerte, die bei allen Wertpapierleihgeschäften eingesetzt worden sind, beläuft sich zum 30. September 2021 auf:

| Teilfonds | Art des Vermögenswerts | Währung | Marktwert | % des verwalteten Vermögens | % der verleihbaren Vermögenswerte |
|---|---|---|---|---|---|
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | Wertpapierleihgeschäfte | USD | 4.606.308,91 | 0,98 | 1,02 |
| NN (L) Asian High Yield | Wertpapierleihgeschäfte | USD | 4.174.404,92 | 1,67 | 1,81 |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | Wertpapierleihgeschäfte | USD | 1.362.135,54 | 0,91 | 0,98 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | Wertpapierleihgeschäfte | USD | 131.856.689,13 | 1,87 | 2,02 |
| NN (L) EURO Equity | Wertpapierleihgeschäfte | EUR | 3.418.496,00 | 0,96 | 0,96 |
| NN (L) European High Dividend | Wertpapierleihgeschäfte | EUR | 1.009.539,56 | 0,48 | 0,48 |
| NN (L) European High Yield | Wertpapierleihgeschäfte | EUR | 6.572.074,45 | 4,70 | 4,86 |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | Wertpapierleihgeschäfte | EUR | 3.840.526,32 | 0,89 | 0,91 |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | Wertpapierleihgeschäfte | USD | 16.159.502,82 | 4,59 | 4,87 |
| NN (L) Global High Yield | Wertpapierleihgeschäfte | EUR | 74.943.956,24 | 3,47 | 3,60 |
| NN (L) US High Yield | Wertpapierleihgeschäfte | USD | 4.072.261,63 | 1,44 | 1,50 |

Der Betrag der Vermögenswerte, die bei Total Return Swaps eingesetzt worden sind, beläuft sich zum 30. September 2021 auf:

| Teilfonds | Art des Vermögenswerts | Währung | Marktwert | % des verwalteten Vermögens |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Commodity Enhanced | Total Return Swaps | USD | 3.794.301,71 | 1,93 |
| NN (L) Euro Fixed Income | Total Return Swaps | EUR | 810.811,86 | 0,07 |
| NN (L) Multi Asset Factor Opportunities | Total Return Swaps | USD | 2.792.482,87 | 0,84 |

**Angaben zur Weiterverwendung von Sicherheiten**

In dem am 30. September 2021 beendeten Berichtszeitraum wurden keine Sicherheiten weiterverwendet.

**Angaben zur Konzentration**

Die zehn wichtigsten Emittenten erhaltener Sicherheiten für alle Wertpapierfinanzierungsgeschäfte waren zum 30. September 2021 folgende:

| Teilfonds | Sicherheitenemittent | Währung | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten |
|---|---|---|---|
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | Britischer Staat | USD | 4.135.241,91 |
| | Französischer Staat | USD | 1.213.829,43 |
| NN (L) Asian High Yield | Britischer Staat | USD | 2.312.302,05 |
| | Entfällt* | USD | 2.100.000,00 |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Sicherheitenemittent | Währung | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten |
|---|---|---|---|
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | Britischer Staat | USD | 1.527.649,79 |
| | US-amerikanischer Staat | USD | 627,35 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | Britischer Staat | USD | 96.850.720,72 |
| | Belgischer Staat | USD | 17.661.351,31 |
| | Deutscher Staat | USD | 14.734.490,77 |
| | US-amerikanischer Staat | USD | 11.742.347,70 |
| | Französischer Staat | USD | 7.041.743,00 |
| | Entfällt* | USD | 1.155.000,00 |
| NN (L) EURO Equity | US-amerikanischer Staat | EUR | 3.805.436,26 |
| NN (L) European High Dividend | US-amerikanischer Staat | EUR | 1.119.547,11 |
| NN (L) European High Yield | Belgischer Staat | EUR | 5.230.412,03 |
| | US-amerikanischer Staat | EUR | 2.310.773,92 |
| | Niederländischer Staat | EUR | 3,26 |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | Britischer Staat | EUR | 4.382.792,86 |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | Belgischer Staat | USD | 9.237.838,73 |
| | Britischer Staat | USD | 5.923.190,56 |
| | Deutscher Staat | USD | 1.661.375,41 |
| | Französischer Staat | USD | 1.042.199,85 |
| | Entfällt* | USD | 253.575,88 |
| NN (L) Global High Yield | Britischer Staat | EUR | 75.404.617,96 |
| | Belgischer Staat | EUR | 6.447.727,16 |
| | Französischer Staat | EUR | 3.351.502,78 |
| | Niederländischer Staat | EUR | 1.013,82 |
| | Entfällt* | EUR | 19,65 |
| NN (L) US High Yield | Belgischer Staat | USD | 2.513.163,32 |
| | US-amerikanischer Staat | USD | 2.197.319,59 |

* Barsicherheit.

Die wichtigsten Gegenparteien für jede Einzelart von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps waren zum 30. September 2021 folgende:

| Teilfonds | Art des Wertpapiers | Gegenpartei | Währung | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Asian Debt (Hard Currency) | Wertpapier-leihgeschäfte | Barclays Capital Securities Ltd | USD | 4.135.241,91 |
| | | Merrill Lynch International | USD | 1.213.829,43 |
| NN (L) Asian High Yield | Wertpapier-leihgeschäfte | Barclays Capital Securities Ltd | USD | 2.312.302,05 |
| | | Merrill Lynch International | USD | 2.100.000,00 |
| NN (L) Emerging Markets Corporate Debt | Wertpapier-leihgeschäfte | Goldman Sachs International Ltd | USD | 1.528.277,14 |
| NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency) | Wertpapier-leihgeschäfte | Barclays Capital Securities Ltd | USD | 72.323.988,50 |
| | | Citigroup Global Markets Limited | USD | 43.309.705,23 |
| | | JP Morgan Securities PLC | USD | 17.661.349,40 |
| | | Nomura International PLC | USD | 14.735.610,37 |
| | | Merrill Lynch International | USD | 1.155.000,00 |
| NN (L) EURO Equity | Wertpapier-leihgeschäfte | Societe Generale International | EUR | 3.805.436,26 |
| NN (L) European High Dividend | Wertpapier-leihgeschäfte | Goldman Sachs International Ltd | EUR | 1.119.547,11 |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Teilfonds | Art des Wertpapiers | Gegenpartei | Währung | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) European High Yield | Wertpapier-leihgeschäfte | Barclays Capital Securities Ltd | EUR | 4.917.281,09 |
| | | Goldman Sachs International Ltd | EUR | 2.310.773,92 |
| | | JP Morgan Securities PLC | EUR | 313.134,20 |
| NN (L) First Class Yield Opportunities | Wertpapier-leihgeschäfte | Barclays Capital Securities Ltd | EUR | 3.012.834,63 |
| | | Goldman Sachs International Ltd | EUR | 1.369.958,23 |
| NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency) | Wertpapier-leihgeschäfte | Barclays Capital Securities Ltd | USD | 5.923.190,56 |
| | | Citigroup Global Markets Limited | USD | 5.514.787,59 |
| | | Nomura International PLC | USD | 5.384.555,86 |
| | | Merrill Lynch International | USD | 1.295.646,42 |
| NN (L) Global High Yield | Wertpapier-leihgeschäfte | Barclays Capital Securities Ltd | EUR | 40.053.509,47 |
| | | Goldman Sachs International LTD | EUR | 35.351.108,49 |
| | | JP Morgan Securities PLC | EUR | 6.158.265,22 |
| | | Merrill Lynch International | EUR | 3.351.522,43 |
| | | Citigroup Global Markets Limited | EUR | 290.475,76 |
| NN (L) US High Yield | Wertpapier-leihgeschäfte | Barclays Capital Securities Ltd | USD | 2.513.163,32 |
| | | Goldman Sachs International Ltd | USD | 2.197.319,59 |

| Teilfonds | Art des Wertpapiers | Gegenpartei | Währung | Nicht realisierter Gewinn (oder Verlust) |
|---|---|---|---|---|
| NN (L) Commodity Enhanced | Total Return Swaps | Société Générale SA | USD | 3.794.301,71 |
| NN (L) Euro Fixed Income | Total Return Swaps | NN Re (Netherlands) NV | EUR | 810.811,86 |
| NN (L) Multi Asset Factor Opportunities | Total Return Swaps | Société Générale SA | USD | 2.792.482,87 |

**Verwahrung erhaltener Sicherheiten**

Alle erhaltenen Sicherheiten wurden zum 30. September 2021 von einer einzigen Depotbank verwahrt: Brown Brothers Harriman (Luxembourg) S.C.A.

**Aggregierte Transaktionsdaten**

Die aggregierten Transaktionsdaten für erhaltende Sicherheiten (einschließlich Barmittel) für jede Einzelart von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps waren zum 30. September 2021 folgende:

| Art des abgesicherten Wertpapiers | Art der Sicherheiten | Währung | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten | Qualität | Laufzeit der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist (nicht der Sicherheit) | Abwicklung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **NN (L) Asian Debt (Hard Currency)** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | | | | | | |
| Barclays Capital Securities Ltd | Staatsanleihe | USD | 4.135.241,91 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Merrill Lynch International | Staatsanleihe | USD | 1.213.829,43 | AA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| **Art des abgesicherten Wertpapiers** | **Art der Sicherheiten** | **Währung** | **Marktwert der erhaltenen Sicherheiten** | **Qualität** | **Laufzeit der Sicherheiten** | **Währung der Sicherheiten** | **Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist** (nicht der Sicherheit) | **Abwicklung und Clearing** |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **NN (L) Asian High Yield** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | | | | | | |
| Barclays Capital Securities Ltd | Staatsanleihe | USD | 2.312.302,05 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Merrill Lynch International | Barmittel | USD | 2.100.000,00 | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| **NN (L) Emerging Markets Corporate Debt** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | | | | | | |
| Goldman Sachs International LTD | Staatsanleihe | USD | 1.527.649,79 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Goldman Sachs International LTD | Staatsanleihe | USD | 627,35 | AAA | Über ein Jahr | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| **NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)** | | | | | | | | |
| Barclays Capital Securities Ltd | Staatsanleihe | USD | 72.323.988,50 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Citigroup Global Markets Limited | Staatsanleihe | USD | 24.526.732,22 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| JP Morgan Securities PLC | Staatsanleihe | USD | 17.661.349,40 | AA- | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Nomura International PLC | Staatsanleihe | USD | 14.734.490,77 | AAA | Drei Monate bis ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Citigroup Global Markets Limited | Staatsanleihe | USD | 11.742.347,70 | AAA | Eine Woche bis ein Monat | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Citigroup Global Markets Limited | Staatsanleihe | USD | 7.040.623,40 | AA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Merrill Lynch International | Barmittel | USD | 1.155.000,00 | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Nomura International PLC | Staatsanleihe | USD | 1.119,60 | AA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Citigroup Global Markets Limited | Staatsanleihe | USD | 1,91 | AA- | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| **NN (L) EURO Equity** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | | | | | | |
| Societe Generale International | Staatsanleihe | EUR | 3.805.436,26 | AAA | Ein Monat bis drei Monate | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| **NN (L) European High Dividend** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | | | | | | |
| Goldman Sachs International Ltd | Staatsanleihe | EUR | 1.119.547,11 | Entfällt | Über ein Jahr | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Art des abgesicherten Wertpapiers | Art der Sicherheiten | Währung | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten | Qualität | Laufzeit der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist (nicht der Sicherheit) | Abwicklung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **NN (L) European High Yield** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgesch-äfte** | | | | | | | | |
| Barclays Capital Securities Ltd | Staatsanleihe | EUR | 4.917.281,09 | AA- | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Goldman Sachs International Ltd | Staatsanleihe | EUR | 2.310.773,92 | AAA | Über ein Jahr | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| JP Morgan Securities PLC | Staatsanleihe | EUR | 313.130,94 | AA- | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| JP Morgan Securities PLC | Staatsanleihe | EUR | 3,26 | AAA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| **NN (L) First Class Yield Opportunities** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgesch äfte** | | | | | | | | |
| Barclays Capital Securities Ltd | Staatsanleihe | EUR | 3.012.834,63 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Goldman Sachs International Ltd | Staatsanleihe | EUR | 1.369.958,23 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| **NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgeschäf** | | | | | | | | |
| Barclays Capital Securities Ltd | Staatsanleihe | USD | 5.923.190,56 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Nomura International PLC | Staatsanleihe | USD | 5.384.427,84 | AA- | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Citigroup Global Markets Limited | Staatsanleihe | USD | 3.853.410,89 | AA- | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Citigroup Global Markets Limited | Staatsanleihe | USD | 1.661.375,41 | AAA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Merrill Lynch International | Staatsanleihe | USD | 1.042.070,54 | AA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Merrill Lynch International | Barmittel | USD | 253.575,88 | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Nomura International PLC | Staatsanleihe | USD | 128,02 | AA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Citigroup Global Markets Limited | Staatsanleihe | USD | 1,29 | AA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| **NN (L) Global High Yield** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgesch äfte** | | | | | | | | |
| Barclays Capital Securities Ltd | Staatsanleihe | EUR | 40.053.509,47 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Goldman Sachs International Ltd | Staatsanleihe | EUR | 35.351.108,49 | AA- | Über ein Jahr | GBP | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| JP Morgan Securities PLC | Staatsanleihe | EUR | 6.158.265,22 | AA- | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Merrill Lynch International | Staatsanleihe | EUR | 3.351.502,78 | AA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Citigroup Global Markets Limited | Staatsanleihe | EUR | 289.461,94 | AA- | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Citigroup Global Markets Limited | Staatsanleihe | EUR | 1.013,82 | AAA | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Art des abgesicherten Wertpapiers | Art der Sicherheiten | Währung | Marktwert der erhaltenen Sicherheiten | Qualität | Laufzeit der Sicherheiten | Währung der Sicherheiten | Land, in dem die Gegenpartei niedergelassen ist (nicht der Sicherheit) | Abwicklung und Clearing |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| **NN (L) Global High Yield (Fortsetzung)** | | | | | | | | |
| Merrill Lynch International | Barmittel | EUR | 19,65 | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| **NN (L) US High Yield** | | | | | | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | | | | | | |
| Barclays Capital Securities Ltd | Staatsanleihe | USD | 2.513.163,32 | AA- | Über ein Jahr | EUR | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| Goldman Sachs International Ltd | Staatsanleihe | USD | 2.197.319,59 | AAA | Über ein Jahr | USD | Vereinigtes Königreich | Trilateral |
| **NN (L) Commodity Enhanced** | | | | | | | | |
| **Total Return Swaps*** | | | | | | | | |
| Goldman Sachs | Barmittel | USD | 2.680.000,00 | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigtes Königreich | Bilateral |
| Société Générale | Barmittel | USD | 2.920.000,00 | Entfällt | Entfällt | USD | Frankreich | Bilateral |
| State Street Bank | Barmittel | USD | (7.300.000,00) | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigte Staaten | Bilateral |
| **NN (L) Euro Fixed Income** | | | | | | | | |
| **Total Return Swaps*** | | | | | | | | |
| Bank of America | Barmittel | EUR | 810.000,00 | Entfällt | Entfällt | EUR | Vereinigte Staaten | Bilateral |
| Bank of New York Mellon | Barmittel | EUR | 1.250.000,00 | Entfällt | Entfällt | EUR | Vereinigte Staaten | Bilateral |
| BNP Paribas | Barmittel | EUR | 3.400.000,00 | Entfällt | Entfällt | EUR | Frankreich | Bilateral |
| Citigroup | Barmittel | EUR | (160.000,00) | Entfällt | Entfällt | EUR | Vereinigtes Königreich | Bilateral |
| Goldman Sachs | Barmittel | EUR | 550.000,00 | Entfällt | Entfällt | EUR | Vereinigtes Königreich | Bilateral |
| HSBC Bank Plc | Barmittel | EUR | 630.000,00 | Entfällt | Entfällt | EUR | Vereinigtes Königreich | Bilateral |
| JP Morgan Chase Bank | Barmittel | EUR | 480.000,00 | Entfällt | Entfällt | EUR | Vereinigte Staaten | Bilateral |
| Morgan Stanley | Barmittel | EUR | 760.000,00 | Entfällt | Entfällt | EUR | Vereinigtes Königreich | Bilateral |
| **NN (L) Multi Asset Factor Opportunities** | | | | | | | | |
| **Total Return Swaps*** | | | | | | | | |
| Bank of America | Barmittel | USD | (500.000,00) | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigte Staaten | Bilateral |
| Barclays | Barmittel | USD | 1.880.000,00 | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigtes Königreich | Bilateral |
| BNP Paribas | Barmittel | USD | 1.560.000,00 | Entfällt | Entfällt | USD | Frankreich | Bilateral |
| HSBC Bank Plc | Barmittel | USD | (880.000,00) | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigtes Königreich | Bilateral |
| JP Morgan Chase Bank | Barmittel | USD | (640.000,00) | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigte Staaten | Bilateral |
| Morgan Stanley | Barmittel | USD | 360.000,00 | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigtes Königreich | Bilateral |
| Société Générale | Barmittel | USD | (15.630.000,30) | Entfällt | Entfällt | USD | Frankreich | Bilateral |
| State Street Bank | Barmittel | USD | (7.200.000,01) | Entfällt | Entfällt | USD | Vereinigte Staaten | Bilateral |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

* Die ausgewiesenen Beträge beziehen sich auf außerbörsliche Derivatepositionen und nicht nur auf Total Return Swaps.

Die Laufzeiten der Wertpapierfinanzierungsgeschäfte und Total Return Swaps sind folgende:
Per 30. September 2021 hatten alle Wertpapierleihgeschäfte offene Laufzeiten.
Per 30. September 2021 wird die Fälligkeit aller Total Return Swaps in der Aufstellung „Derivative Finanzinstrumente“ des jeweiligen Teilfonds angegeben.
Für den Teilfonds NN (L) Commodity Enhanced liegt die Laufzeit des Total Return Swaps zwischen drei Monaten und einem Jahr.
Für den Teilfonds NN (L) Euro Fixed Income liegt die Laufzeit des Total Return Swaps zwischen einem Monat und drei Monaten.
Für den Teilfonds NN (L) Multi Asset Factor Opportunities liegt die Laufzeit zweier Total Return Swaps zwischen drei Monaten und einem Jahr und die Laufzeit der übrigen Total Return Swaps zwischen einem Monat und drei Monaten.

**Verwahrung gestellter Sicherheiten**

Die Stellung von Sicherheiten erfolgt auf Basis einer Eigentumsübertragung, und der Fonds kann diese Sicherheiten jederzeit wieder zurückfordern. Die Gegenpartei ist lediglich verpflichtet, dem Fonds denselben Betrag zurückzuerstatten, und solange eine Exponierung gegenüber der zugrunde liegenden Transaktion besteht, kann dieser Betrag vom Fonds nicht „jederzeit“ zurückgefordert werden.

In dem am 30. September 2021 beendeten Geschäftsjahr wurden keine Sicherheiten gestellt.

**Rendite/Kosten**

Die in Erläuterung 16 angegebenen Nettorenditen lassen sich aufgrund der Zeitunterschiede bei der Übermittlung und Verarbeitung von Daten der beteiligten Parteien nicht mit den in Erläuterung 13 angegebenen Erträgen aus Wertpapierleihgeschäften vergleichen.

Die Renditen und Kosten für jede Art von Wertpapierfinanzierungsgeschäften und Total Return Swaps für das am 30. September 2021 beendete Geschäftsjahr sind wie folgt:

| Rendite | Währung | Betrag | % der Gesamtrendite |
|---|---|---|---|
| **NN (L) Asia Income** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 2.063,81 | 100,00% |
| **NN (L) Asian Debt (Hard Currency)** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 68.980,81 | 100,00% |
| **NN (L) Asian High Yield** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 40.405,69 | 100,00% |
| **NN (L) Emerging Europe Equity** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 8.189,92 | 100,00% |
| **NN (L) Emerging Markets Corporate Debt** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 2.730,51 | 100,00% |
| **NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 368.849,00 | 100,00% |
| **NN (L) EURO Equity** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 96.712,11 | 100,00% |
| **NN (L) Euro Income** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 10.730,52 | 100,00% |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Rendite | Währung | Betrag | % der Gesamtrendite |
|---|---|---|---|
| **NN (L) European Equity** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 32.651,42 | 100,00% |
| **NN (L) European High Dividend** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 18.920,04 | 100,00% |
| **NN (L) European High Yield** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 26.733,29 | 100,00% |
| **NN (L) First Class Yield Opportunities** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 9.389,50 | 100,00% |
| **NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 28.300,63 | 100,00% |
| **NN (L) Global High Dividend** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 19.138,40 | 100,00% |
| **NN (L) Global High Yield** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 281.362,81 | 100,00% |
| **NN (L) Greater China Equity** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 180.568,64 | 100,00% |
| **NN (L) US High Yield** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 17.012,83 | 100,00% |

| Rendite | Währung | Betrag | % der Gesamtrendite |
|---|---|---|---|
| **NN (L) Commodity Enhanced** | | | |
| **Total Return Swaps** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 53.405.309,01 | 100,00% |
| **NN (L) Euro Fixed Income** | | | |
| **Total Return Swaps** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 2.314.150,31 | 100,00% |
| **NN (L) Multi Asset Factor Opportunities** | | | |
| **Total Return Swaps** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 30.418.360,73 | 100,00% |

| Kosten | Währung | Betrag | % der Gesamtkosten |
|---|---|---|---|
| **NN (L) Asia Income** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 179,50 | 100,00% |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Kosten | Währung | Betrag | % der Gesamtkosten |
|---|---|---|---|
| **NN (L) Asian Debt (Hard Currency)** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 5.998,30 | 100,00% |
| **NN (L) Asian High Yield** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 3.513,68 | 100,00% |
| **NN (L) Emerging Europe Equity** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 712,18 | 100,00% |
| **NN (L) Emerging Markets Corporate Debt** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 237,55 | 100,00% |
| **NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 32.076,10 | 100,00% |
| **NN (L) EURO Equity** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 8.409,89 | 100,00% |
| **NN (L) Euro Income** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 933,06 | 100,00% |
| **NN (L) European Equity** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 2.839,28 | 100,00% |
| **NN (L) European High Dividend** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 1.645,29 | 100,00% |
| **NN (L) European High Yield** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 2.324,73 | 100,00% |
| **NN (L) First Class Yield Opportunities** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| An Fonds: | EUR | 815,94 | 100,00% |
| **NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 2.459,96 | 100,00% |
| **NN (L) Global High Dividend** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 1.663,93 | 100,00% |
| **NN (L) Global High Yield** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | EUR | 24.466,63 | 100,00% |
| **NN (L) Greater China Equity** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 15.701,54 | 100,00% |

# Erläuterungen zu den Finanzabschlüssen (Fortsetzung)

| Kosten | Währung | Betrag | % der Gesamtkosten |
|---|---|---|---|
| **NN (L) US High Yield** | | | |
| **Wertpapierleihgeschäfte** | | | |
| an Teilfonds: | USD | 1.479,26 | 100,00% |

**17- PORTFOLIOUMSCHLAGSRATE**

Die Portfolioumschlagsrate (PTR) ist ein Indikator für die Relevanz der zusätzlichen Kosten, die dem Fonds beim Kauf und Verkauf von Anlagen im Einklang mit seiner Anlagepolitik entstehen.

Die Portfolioumschlagsrate wird nach der unten beschriebenen Methode wie folgt berechnet:

Umschlag = [(Summe 1-Summe 2)/M]*100

Summe 1 = Summe der Wertpapiergeschäfte im maßgeblichen Zeitraum = X + Y
X = Käufe
Y = Verkäufe

Summe 2 = Summe der Kapitaltransaktionen im maßgeblichen Zeitraum = S + R
S = Zeichnungen
R = Rücknahmen

M = Durchschnittliches Nettovermögen

Die Portfolioumschlagsrate wird als Prozentsatz angegeben. In die Berechnung des Portfolioumschlags fließen die in NN (L) Liquid getätigten Geschäfte nicht ein, die mit dem Liquiditätsmanagement verbunden sind.

**18- EREIGNISSE NACH DEM BILANZSTICHTAG**

Es sind keine wesentlichen Ereignisse eingetreten, über die zu berichten wäre.

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)

**ALFI-Verhaltenskodex**

Hierdurch wird bestätigt, dass NN (L) die Grundsätze des „Verhaltenskodex für Luxemburger Investmentfonds“ des Luxemburger Fondsverbands ALFI beachtet und einhält.

**Vergütungsbericht – 2020 – NN Investment Partners B.V. (Verwaltungsgesellschaft)**

**Einleitung**

Dieser Vergütungsbericht beschreibt die Vergütungsleitlinien und das Vergütungssystem von NN Investment Partners B.V. (NN IP), das für Mitarbeiter gilt, die Tätigkeiten für NN IP, einschließlich ihrer Investmentfonds, die unter die Richtlinie über die Verwalter alternativer Investmentfonds („AIFM-Richtlinie“) und/oder die Richtlinie über Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW-Richtlinie“) fallen, ausüben.

Dieser Bericht ist in folgende Abschnitte unterteilt:

I. Vergütung im Allgemeinen;
II. Governance der Vergütung;
III. Vergütung für identifizierte Mitarbeiter und
IV. Quantitative Informationen.

**I. Vergütung im Allgemeinen**

NN IP ist eine Tochtergesellschaft der NN Group und hält sämtliche Standards und Leitlinien ein, die innerhalb der NN Group gelten.

Um mehr Informationen über die NN Group bereitzustellen, findet sich im Folgenden eine ausführliche Darstellung.

Die NN Group verfügt über eine für alle Mitarbeiter geltende allgemeine Vergütungspolitik, die im Vergütungsrahmen der NN Group (NN Group Remuneration Framework) niedergelegt ist. Dieser Vergütungsrahmen legt Leitlinien und Grundsätze für die Vergütungspolitiken in allen Länder- und Geschäftseinheiten innerhalb der NN Group fest. Die NN Group wendet eine klare und transparente Vergütungspolitik an, die angemessen ist, um fachkundige Führungskräfte, leitende und andere hochqualifizierte Mitarbeiter gewinnen und binden zu können. Die Vergütungspolitik ist ferner so konzipiert, dass sie die Mitarbeiter von NN unterstützt, integer zu handeln und die Interessen unserer Stakeholder, welche sich auch auf die Zukunft unserer Kunden und unseres Unternehmens erstrecken, sorgfältig abzuwägen.

Die Vergütungspolitik der NN Group für Führungskräfte und leitende Mitarbeiter basiert auf dem Ansatz der Gesamtvergütung und wird regelmäßig mit der Vergütungspolitik maßgeblicher nationaler und internationaler Wettbewerber gleichen Ranges innerhalb und außerhalb des Finanzsektors verglichen. Es werden klare finanzielle und nichtfinanzielle Leistungsziele gesetzt, die, sowohl kurz- als auch langfristig, auf die allgemeine Strategie des Unternehmens ausgerichtet sind, um zu gewährleisten, dass die Vergütung ordnungsgemäß an die Leistung des einzelnen Mitarbeiters, des Teams und des Unternehmens geknüpft ist. Insbesondere bei den für NN IP tätigen Portfoliomanagern wird die Leistung direkt an die ein-, drei- und fünfjährige relative Performance der verwalteten Fonds geknüpft, was im Interesse unserer Kunden ist. Darüber hinaus fördert die Vergütungspolitik die Fokussierung auf die langfristigen Interessen des Unternehmens und die Interessen seiner Kunden, indem sie sicherstellt, dass die Risiken sorgfältig gesteuert werden und die Mitarbeiter nicht über die Vergütung dazu verleitet werden, übermäßige Risiken einzugehen. Darüber hinaus stellt die Vergütungspolitik sicher, dass die NN Group sämtliche einschlägigen (inter)nationalen Vergütungsvorschriften, wie das niederländische Gesetz betreffend die Vergütungspolitik von Finanzunternehmen (Wet beloningsbeleid financiële ondernemingen), soweit sie für unsere Geschäftstätigkeit maßgeblich sind, einhält.

Neben der bar zu zahlenden variablen Vergütung wendet die NN Group einen abgestimmten Vergütungsplan (Aligned Remuneration Plan, ARP) an, der NN IP erlaubt, zurückgestellte Vergütungen in Form von Fonds, die von NN Investment Partners verwaltet werden, zu gewähren, um die Interessen der Mitarbeiter und die Interessen unserer Kunden stärker aufeinander abzustimmen. Der ARP erlaubt ebenfalls, dass nach Maßgabe einer für alle Mitarbeiter geltenden Zurückstellungspolitik NN Group-Anteile zuerkannt werden. Die allgemeine Praxis für Mitarbeiter von NN IP, die die in der Politik festgelegten Zurückstellungsschwellen überschreiten und keine identifizierten Mitarbeiter sind, besteht darin, 50% der zurückgestellten variablen Vergütung in von NN IP verwalteten Fonds und die übrigen 50% der zurückgestellten variablen Vergütung in NN Group-Anteilen zu leisten.

Die Parameter für das Zurückstellungssystem werden vom Vorstand der NN Group festgelegt und vom Aufsichtsrat der NN Group genehmigt, wobei externe Marktpraktiken Berücksichtigung finden. Zu diesen Parametern gehören: a) der Anteil der variablen Vergütung, der zurückgestellt wird (der Anteil stellt sicher, dass ein erheblicher Teil der variablen Vergütung hochbezahlter Mitarbeiter zurückgestellt wird); b) der Zeithorizont der Zurückstellung (Bezugszeitraum) und c) die Zurückstellungsinstrumente, die eingesetzt werden (z.B. mit Aktien verbundene Instrumente, die den Wert der Zurückstellung an die Performance der NN Group oder der Produkte der NN Group knüpfen).

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

Der Vergütungsrahmen und der ARP enthalten sowohl Einbehalts- als auch Rückforderungsklauseln, die geltend gemacht werden können, falls nach der Zuerkennung Leistungs-, Risiko-, Compliance- oder andere Probleme entdeckt werden.

Neben den vorstehend beschriebenen, für alle Mitarbeiter geltenden allgemeinen Vergütungsgrundsätzen der NN Group gelten die folgenden drei Grundsätze insbesondere für die Vergütung von Mitarbeitern in Kontrollfunktionen (d.h. Mitarbeiter in den Bereichen Risk, Compliance, Legal, Finance, HR und Audit):

- die feste Vergütung ist hoch genug, um sicherzustellen, dass qualifizierte und erfahrene Mitarbeiter beschäftigt werden können;
- das Verhältnis von fester zu variabler Vergütung ist zugunsten der festen Vergütung gewichtet und
- die variable Vergütung basiert vorwiegend auf funktionsspezifischen Zielen, die qualitative Kriterien umfassen, die nicht vom Finanzergebnis der Unternehmenseinheit bestimmt sind, die von den Kontrollfunktionen direkt überwacht wird.

Die Vergütungspolitiken, die für Mitarbeiter gelten, die Tätigkeiten für alternative Investmentfonds („AIF“), Organismen für gemeinsame Anlagen in Wertpapieren („OGAW“) und/oder die Verwaltungsgesellschaft ausüben, stellen sicher, dass NN IP sämtliche (inter)nationalen Vergütungsvorschriften wie das niederländische Wet beloningsbeleid financiële ondernemingen (Wbfo), die AIFM-Richtlinie und die OGAW-Richtlinie, soweit sie für unsere Geschäftstätigkeit einschlägig sind, einhält und in deren Geist handelt.

**II. Governance der Vergütung**

Die Governance der Vergütung von NN IP ist in den Governancerahmen der NN Group (NN Group Governance Framework) eingebettet, der vorsieht, dass bestimmte Vergütungsvorschläge auf Ebene der NN Group zu genehmigen sind. Das umfasst die Voraussetzungen für Genehmigungen durch (i) den Vergütungsausschuss der NN Group, in dem die relevanten Kontrollfunktionen (Finance, Risk, HR, Legal und Compliance) sowie die Mitglieder der Geschäftsleitung der NN Group vertreten sind, und (ii) den Aufsichtsrat der NN Group, um eine objektive und unabhängige Einschätzung sicherzustellen.
Beispiele für Ereignisse bei NN IP, die einer Zustimmung auf Ebene der NN Group bedürfen, sind:

- die Auswahlmethode, die Auswahlkriterien und die jährliche Auswahl der Aufgaben der identifizierten Mitarbeiter (d.h. jener Mitarbeiter, die wesentlichen Einfluss auf das Risikoprofil der NN Group haben, und jener Mitarbeiter, die wesentlichen Einfluss auf die AIF, OGAW und/oder die Verwaltungsgesellschaft NN IP haben) und die Vergütungsvorschläge;
- Beschlüsse hinsichtlich der Vergütung der Mitglieder des Vergütungsausschusses von NN IP;
- die jährliche Überprüfung der Vergütung ausgewählter Mitglieder des Kreises der identifizierten Mitarbeiter, der Geschäftsleitung und der hochbezahlten Mitarbeiter, einschließlich eines etwaigen Einbehalts zurückgestellter Vergütungen durch Anwendung von Malus- oder Einbehaltsklausen;
- der Gesamtbetrag der variablen Vergütungsausgaben für das jeweilige Leistungsjahr;
- Stellenangebote für neue Mitarbeiter und Vorschläge für ausscheidende Mitarbeiter, die bestimmte Schwellenwerte überschreiten; und
- etwaige Abweichungen von den im Vergütungsrahmen der NN Group festgelegten Mindeststandards.

Überdies verfügt NN IP über einen Vergütungsausschuss, der (unter anderem) für die Festlegung, Überwachung und Überprüfung der Vergütungspolitiken und die weltweit für NN IP insgesamt getätigten Vergütungsausgaben verantwortlich ist. Der Vergütungsausschuss von NN IP setzt sich aus dem CEO von NN IP, dem Leiter des Bereichs Human Resources von NN IP, dem Chief Financial & Risk Officer von NN IP, dem Leiter des Bereichs Compliance von NN IP und dem Leiter des Bereichs Reward von NN IP zusammen. Darüber hinaus ist der Leiter des Bereichs Reward der NN Group eingeladen, an allen Sitzungen teilzunehmen.

Die Vergütungsausschüsse und der Aufsichtsrat der NN Group sind ermächtigt, externe Vergütungsberater zu beauftragen. 2020 wurden die Dienste von Willis Towers Watson in Anspruch genommen, und NN IP nahm zusätzlich die Dienste von McLagan und PwC in Bezug auf vergütungsbezogene Politiken und Praktiken (einschließlich Benchmarking) in Anspruch.

Weitere Informationen bezüglich der Governance der Vergütung, einschließlich der Aufgaben und Zuständigkeiten der einschlägigen Ausschüsse sind im Jahresbericht 2020 der NN Group zu finden (https://www.nn-group.com – Investors – 2020 Annual report).

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

**III. Vergütung für identifizierte Mitarbeiter**

**Einleitung**

NN IP wählte identifizierte Mitarbeiter (Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeit sich wesentlich auf das Risikoprofil der NN Group auswirkt) auf Grundlage der niederländischen Verordnung Regeling Beheerst Beloningsbeleid Wft 2017 (Rbb 2017) und identifizierte Mitarbeiter auf Grundlage der AIFM-Richtlinie und der OGAW-Richtlinie (Mitarbeiter, deren berufliche Tätigkeit sich wesentlich auf in den Niederlanden zugelassene AIF und/oder OGAW und/oder die in The Hague ansässige NN IP auswirken) aus. Sämtliche identifizierten Mitarbeiter von NN IP, die auf Grundlage der Rbb 2017 ausgewählt wurden, haben auch den Status eines auf Grundlage der AIFM-Richtlinie und der OGAW-Richtlinie ausgewählten identifizierten Mitarbeiters.

Auf Grundlage der AIFM-Richtlinie und der OGAW-Richtlinie ausgewählte identifizierte Mitarbeiter werden gemäß den ESMA-Leitlinien und anhand von Auswahlmethoden und Auswahlkriterien ausgewählt, die vom Vergütungsausschuss von NN IP und vom Vergütungsausschuss der NN Group genehmigt wurden.

Die Bewertung des wesentlichen Einflusses gründete sich konkret auf folgende Kriterien:

- Prüfung, inwieweit potenzielle Auswirkungen auf die finanziellen, operationellen und Reputationsrisiken bestehen, die die Risikobereitschaft des Unternehmens und/oder die Performance des AIF und/oder der OGAW übersteigen;
- formale Position innerhalb der Organisation, einschließlich anwendbare Governance sowie Aufgaben und Zuständigkeiten, entweder allein oder in Ausschüssen, in der Organisationseinheit oder als Teil einer Abteilung;
- tatsächliche Situation (Vergleich von tatsächlicher und theoretischer Situation), sofern die tatsächliche Situation als eine führende erachtet wird;
- Berücksichtigung eingerichteter Kontrollen und Fokussierung auf den verbleibenden Einfluss, der unter Berücksichtigung normal funktionierender Kontrollen ausgeübt werden kann; und
- Rückvergleiche mit vergangenen Vorkommnissen und Überwachungsergebnissen (ISAE3402, Financial Reporting Risk), um festzustellen, ob die Kontrollen wirksam funktionieren oder ob außerhalb der bestehenden Kontrollen ein wesentlicher Einfluss ausgeübt werden kann.

Die folgenden sechs Gruppen identifizierter Mitarbeiter wurden bewertet:

(i) an der Geschäftsführung beteiligte und nicht an der Geschäftsführung beteiligte Mitglieder des Leitungsorgans des AIFM und OGAW;
(ii) Geschäftsleitung;
(iii) Mitarbeiter in Kontrollfunktionen;
(iv) Mitarbeiter, die an der Spitze des Portfoliomanagements, der Verwaltung, des Marketings, der Humanressourcen stehen;
(v) sonstige Risikoträger und
(vi) Mitarbeiter deren Vergütung im Vorjahr so hoch wie die der Geschäftsleitung und anderer Risikoträger oder höher war.

**Leistungsmanagement für identifizierte Mitarbeiter**

Der Leistungsmanagement-Prozess für identifizierte Mitarbeiter, die auf Grundlage der Rbb 2017 ausgewählt wurden, wird von NN Group Human Resources zentral konzipiert und koordiniert, und die sich daraus ergebenden Vorschriften und Anforderungen gelten auch für identifizierte Mitarbeiter, die auf Grundlage der AIFM-Richtlinie und der OGAW-Richtlinie ausgewählt wurden.

Die Grundsätze für das Leistungsmanagement, die auf identifizierte Mitarbeiter angewandt werden, stellen sicher, dass Finanzergebnisse und nichtfinanzielle Ergebnisse sowie das Führungsverhalten im Fokus stehen. Außerdem werden die Unternehmensstrategie (sowohl lang- als auch kurzfristige Ziele), die Interessen der Kunden sowie die Unternehmenswerte (Care, Clear und Commit) gestärkt. Die Grundsätze sorgen auch für eine Ausrichtung auf das AIF- und OGAW-Risikoprofil. Neben den für alle Mitarbeiter der NN Group geltenden allgemeinen Grundsätzen für das Leistungsmanagement wurden 2020 die folgenden Grundsätze für das Leistungsmanagement auf identifizierte Mitarbeiter angewandt:

(i) die Leistungsziele umfassen sowohl finanzielle als auch nichtfinanzielle Leistungsziele in folgendem Verhältnis: (a) für nicht in Kontrollfunktionen tätige identifizierte Mitarbeiter ein Höchstwert von 50% an finanziellen und ein Mindestwert von 50% an nichtfinanziellen Leistungszielen und (b) für Kontrollfunktionen ein Höchstwert von 15% an finanziellen (z.B. Zuständigkeit für das Abteilungsbudget) und ein Mindestwert von 85% an nichtfinanziellen Leistungszielen, die mit ihren besonderen Aufgaben im Rahmen ihrer Kontrollfunktion verbunden sind;

(ii) finanzielle Leistungsziele für Kontrollfunktionen sind nur zulässig, wenn sie nicht mit der Leistung der von ihnen kontrollierten Geschäftseinheit verbunden sind, und

(iii) alle Leistungsziele werden von den Risiko- und Compliance-Funktionen überprüft.

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

Für jedes Mitglied des Kreises der identifizierten Mitarbeiter werden Ziele festgelegt, einschließlich Angaben dazu, welchen Beitrag der Mitarbeiter zum Erfolg des Unternehmens leisten soll und wie dieser Beitrag zu erreichen ist. Die individuellen Leistungsziele müssen bestimmte Mindeststandards erfüllen. Dazu gehören die Förderung einer offenen Kultur, klare und fokussierte Ziele sowie die kundenspezifische Eignungsprüfung. Die individuelle Bewertung hinsichtlich des Erreichens der Leistungsziele wird neben anderen Faktoren zur Festlegung der individuellen variablen Vergütung herangezogen. Der Endbetrag der variablen Vergütung hängt auch von anderen Faktoren ab, zum Beispiel: allgemeine Finanzierbarkeit, Beurteilung in Bezug auf unerwünschte Risikoübernahme sowie vorschriftswidriges Verhalten und Ergebnis der Bewertung des Führungsverhaltens, was zu Anpassungen der Höhe der variablen Vergütung führen kann. Vom Vorgesetzten wird erwartet, dass er Risiko- und Compliance-Ereignisse bei der Höhe der variablen Vergütung berücksichtigt. Der Vergütungsausschuss von NN IP überprüft die Anwendung dieser Vorgabe seitens des Vorgesetzten. Verstöße gegen die Risiko- und Compliance-Vorschriften können Risiken im Zusammenhang mit Betriebsstörungen, dem Mitarbeiterverhalten, Fällen von Marktmissbrauch, der kundenspezifischen Eignungsprüfung usw. umfassen.

Die Durchführung der Leistungsbewertung für die identifizierten Mitarbeiter und die anschließende Gewährung der variablen Vergütung ist Bestandteil eines mehrjährigen Rahmens. Da für die variable Vergütung der identifizierten Mitarbeiter Zurückstellungszeiträume gelten, ist sichergestellt, dass die variable Vergütung im gesamten Zurückstellungszeitraum noch angepasst werden kann. Die variable Vergütung ist mit dem Risiko und der nichtfinanziellen Leistung verknüpft und berücksichtigt die Unternehmensleistung auf Gruppenebene, die Leistung des Geschäftsbereichs und die individuelle Leistung. Eine unerwünschte Risikoübernahme oder Compliance-Verstöße, die zum Zeitpunkt der Zuerkennung der variablen Vergütung nicht bekannt waren, werden zum Zeitpunkt des Bezugs der (zurückgestellten) variablen Vergütung berücksichtigt.

**Vergütungsgrundsätze und -politik für identifizierte Mitarbeiter**

Die variable Vergütung für identifizierte Mitarbeiter ist erfolgsabhängig und risikogewichtet und wird teilweise im Voraus und teilweise hinausgeschoben ausbezahlt. Die zurückgestellte variable Vergütung ist von der Beurteilung in puncto unerwünschter Risikoübernahme und vorschriftswidrigem Verhalten im Hinblick auf die vorangegangene Leistung abhängig. Falls der Aufsichtsrat dies für notwendig hält, wird die (zurückgestellte) variable Vergütung mittels Einbehalt oder Rückforderung nach unten angepasst.

**Verschiedene Elemente der Vergütung für identifizierte Mitarbeiter**

Die Vergütung identifizierter Mitarbeiter wurde gemäß den anwendbaren Gesetzen und Vorschriften strukturiert. Die Gesamtvergütung der identifizierten Mitarbeitern besteht aus folgenden Elementen:

- feste Vergütung;
- variable Vergütung und
- allgemeine Sozialleistungen wie Arbeitgeberbeiträge zur Rentenversicherung, Arbeitnehmerrabatte für Finanzdienstleistungen, Berufsunfähigkeitsversicherung (gilt für alle Mitarbeiter von NN IP).

**Identifizierten Mitarbeitern gewährte variable Vergütung**

Ein Mindestanteil von 40% der variablen Vergütung, die identifizierten Mitarbeitern zuerkannt wird, wird zurückgestellt; für identifizierte Mitarbeiter in Kontrollfunktionen gelten strengere Vorschriften, denn ein Mindestanteil von 50% wird zurückgestellt.

Für alle Mitglieder des Kreises der identifizierten Mitarbeiter besteht die variable Vergütung aus folgenden Bestandteilen:

- im Voraus geleistete Barzahlung;
- im Voraus zuerkannte Investmentansprüche, die von NN IP verwaltet werden (nach Bezug gilt eine zusätzliche Sperrfrist von mindestens einem Jahr);
- im Voraus zuerkannte NN Group-Anteile (für CEO von NNIP und Mitglieder der Geschäftsleitung der NN Group; nach Bezug gilt eine zusätzliche Sperrfrist von mindestens fünf Jahren);
- zurückgestellte Investmentansprüche, die von NN IP verwaltet werden (der Mindestzurückstellungszeitraum beträgt drei Jahre bei Anwendung eines gestaffelten Bezugszeitraums. Die zurückgestellte variable Vergütung wird jährlich in gleichen Tranchen bezogen. Der erste zurückgestellte Anteil der variablen Vergütung wird ein Jahr nach der Zuerkennung bezogen. Ein bezogener Anteil der zurückgestellten Fonds unterliegt einer zusätzlichen Sperrfrist von mindestens einem Jahr) und
- zurückgestellte NN Group-Anteile (der Mindestzurückstellungszeitraum beträgt drei Jahre bei Anwendung eines gestaffelten Bezugszeitraums. Die zurückgestellte variable Vergütung wird jährlich in gleichen Tranchen bezogen. Der erste zurückgestellte Anteil der variablen Vergütung wird ein Jahr nach der Zuerkennung bezogen).

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

Für alle ausgewählten identifizierten Mitarbeiter wird eine Ex-post-Leistungsbewertung durchgeführt. Die Leistungsbewertung erstreckt sich über den Tag der Zuerkennung der variablen Vergütung hinaus und setzt sich als Bestandteil des mehrjährigen Rahmens von mindestens drei bis fünf Jahren fort.

Die NN Group ist unter den folgenden Umständen berechtigt, einen Einbehalt gegenüber jedweden (ehemaligen) Mitarbeitern anzuwenden, d.h. die variable Vergütung nicht auszuzahlen:

- die variable Vergütung ist mit der Finanzlage der NN Group nicht vereinbar oder ist auf Grundlage der Leistung der betreffenden Geschäftseinheit oder des betreffenden Mitarbeiters nicht gerechtfertigt oder
- die NN Group hält die jeweils geltenden einschlägigen Kapitalanforderungen nicht ein, was eine erhebliche Verschlechterung der Finanzergebnisse der AIF/OGAW-Verwaltungsgesellschaft und/oder der AIF/OGAW-Fonds oder eine erhebliche Eintrübung der gesamten Finanzlage der AIF/OGAW-Verwaltungsgesellschaft einschließt; oder
- die Kapitalausstattung der NN Group ist gemäß einem Kapitaltest ungenügend; oder
- der betreffende Mitarbeiter war an einem Verhalten beteiligt oder dafür verantwortlich, das der NN Group oder einer ihrer Tochtergesellschaften oder verbundenen Unternehmen erhebliche Verluste beschert hat; oder
- der betreffende Mitarbeiter hat die Standards der Zuverlässigkeit und fachliche Eignung (bekwaamheid en correctheid) nicht erfüllt, zu denen der Eid für den Finanzsektor, der Verhaltenskodex und andere interne Regeln und Vorschriften gehören, die für die NN Group gelten; oder
- bei der NN Group oder der Geschäftseinheit, in der der betreffende Mitarbeiter tätig ist, kommt es zu einem erheblichen Versagen des Risikomanagements; oder
- sofern dies unter Berücksichtigung des Ergebnisses der im Vergütungsrahmen der NN Group vorgesehenen Neubewertungsverfahren vorgeschrieben oder angemessen ist; oder
- im Falle erheblicher negativer Änderungen der wirtschaftlichen oder regulatorischen Kapitalbasis; oder
- im Falle eines besonderen Verhaltens, das zu einer wesentlichen Neufassung des Jahresabschlusses der NN Group und/oder zu einer erheblichen (Ruf-)Schädigung der NN Group oder einer ihrer Tochtergesellschaften oder verbundenen Unternehmen geführt hat; oder
- wenn eine andere wesentliche neue Information bekannt wird, durch die sich die ursprüngliche Erteilung der Zuerkennung der variablen Vergütung an diesen Mitarbeiter geändert hätte, wenn sie zum Zeitpunkt der Zuerkennung bekannt gewesen wäre.

Eine Rückforderung einer gezahlten/bezogenen variablen Vergütung von einem (ehemaligen) Mitarbeiter kann unter folgenden Umständen erfolgen:

- sofern dies unter Berücksichtigung des Ergebnisses der (Neubewertungs-)Verfahren vorgeschrieben und angemessen ist; oder
- falls der Mitarbeiter Verhaltensweisen an den Tag gelegt hat oder Handlungen vorgenommen hat, die als Fehlverhalten oder Betrug gelten; oder
- im Falle eines besonderen Verhaltens, das zu einer wesentlichen Neufassung des Jahresabschlusses der NN Group und/oder zu einer erheblichen (Ruf-)Schädigung der NN Group oder einer ihrer Tochtergesellschaften oder verbundenen Unternehmen geführt hat; oder
- falls der betreffende Mitarbeiter an einem Verhalten beteiligt oder dafür verantwortlich war, das der NN Group oder einer ihrer Tochtergesellschaften oder verbundenen Unternehmen erhebliche Verluste beschert hat; oder
- falls der betreffende Mitarbeiter die Standards der Zuverlässigkeit und fachliche Eignung (bekwaamheid en correctheid) nicht erfüllt hat, zu denen der Eid für den Finanzsektor, der Verhaltenskodex und andere interne Regeln und Vorschriften gehören, die für die NN Group gelten; oder
- eine erhebliche Verschlechterung der Finanzergebnisse der AIF/OGAW-Verwaltungsgesellschaft und/oder der AIF/OGAW-Fonds oder eine erhebliche Eintrübung der gesamten Finanzlage der AIF/OGAW-Verwaltungsgesellschaft; oder
- im Falle erheblicher negativer Änderungen der wirtschaftlichen oder regulatorischen Kapitalbasis; oder
- wenn eine andere wesentliche neue Information bekannt wird, durch die sich die ursprüngliche Erteilung der Zuerkennung der variablen Vergütung an diesen Mitarbeiter geändert hätte, wenn sie zum Zeitpunkt der Zuerkennung bekannt gewesen wäre.

**Vergütung im Jahr 2020**

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

Im Jahr 2020 belief sich der Gesamtbetrag, den NN IP der Gesamtheit der Mitarbeiter zuerkannt hat, auf EUR 97.68 Mio. Der Betrag setzt sich aus der festen Vergütung von EUR 76.59 Mio. und der variablen Vergütung von EUR 21.09 Mio. zusammen. Zum 31. Dezember hatte NN IP 713 Mitarbeiter, davon 6 Führungskräfte. Die Mehrheit der Mitarbeiter wandten ihre Arbeitszeit für Aktivitäten auf, die direkt oder indirekt mit der Verwaltung der Fonds verbunden sind. Eine Vergütung in Form von „Carried Interest" gibt es nicht.
Aus den vorgenannten Beträgen entfallen auf die Gesamtvergütung der Führungskräfte EUR 4.22 Mio., von denen EUR 2.77 Mio. als feste und EUR 1.45 Mio. als variable Vergütung gezahlt wurden.

Die nachstehende Tabelle gibt einen Überblick über die den Mitarbeitern von NN IP zuerkannte Vergütung. Im Jahr 2020 gewährte die Verwaltungsgesellschaft zwei Mitarbeitern eine Vergütung von mehr als EUR 1 Mio. zu.

**IV. Quantitative Informationen**

Die nachstehende Tabelle enthält zusammengefasste Informationen zur Vergütung sämtlicher aktiven Mitarbeiter, die am 31. Dezember 2020 in einem Beschäftigungsverhältnis standen und für NN IP International Holdings B.V. in den Niederlanden im Jahr 2020 Tätigkeiten ausgeübt haben, und sie umfasst sämtliche identifizierten Mitarbeiter, die auf Grundlage der OGAW-Richtlinie ausgewählt wurden.

Ein erheblicher Anteil der nachstehenden Beträge kann NN Investment Partners B.V. (Verwaltungsgesellschaft) zugeordnet werden, da NN Investment Partners B.V. die wichtigste operative Einheit von NN Investment Partners International Holdings B.V. ist.

Informationen auf Ebene von NN Investment Partners B.V. (Verwaltungsgesellschaft) und/oder den AIF/OGAW stehen nicht zur Verfügung. Die variable Vergütung wird den AIF/OGAW nicht direkt in Rechnung gestellt. Die feste Vergütung wird nicht direkt in Rechnung gestellt außer bei Fonds, mit direkter Gebührenerhebung. Bei diesen Fonds wird ein Zuteilungsschlüssel für die Erhebung der festen Vergütung herangezogen.

Zusätzlich ist eine Tabelle mit Angaben zur Vergütung für das Leistungsjahr 2019 beigefügt.

**Gesamtbetrag der festen und variablen Vergütungen für das Leistungsjahr 2020**

| Für das Leistungsjahr 2020 zugeteilte feste und variable Vergütung | | | |
|---|---|---|---|
| **Geldbeträge in Tsd. Euro und brutto** | **Identifizierte Mitarbeiter, eingestuft als Führungskräfte** | **Sonstige identifizierte Mitarbeiter (einschließlich Mitglieder der Geschäftsleitung)** | **Sämtliche Mitarbeiter – ohne identifizierte Mitarbeiter** |
| **Anzahl der Mitarbeiter** | 6 | 29 | 678 |
| **Feste Vergütung (1)** | 2.769 | 6.810 | 67.017 |
| **Variable Vergütung (2)** | 1.454 | 3.650 | 15.983 |
| **Gesamtbetrag feste und variable Vergütung** | 4.223 | 10.460 | 83.000 |

Anmerkung 1): Feste Vergütung per Ultimo 2020 für vertragliche Arbeitsstunden. Die feste Vergütung umfasst tarifliche Pauschalzulagen, die Elemente wie Urlaubsgeld und Zulagen zur Altersvorsorge einschließen, aber Zuwendungen/Leistungen („Benefits") ausschließen.

Anmerkung 2): Die variable Vergütung beinhaltet sämtliche bedingten und unbedingten Prämien in Bezug auf das Leistungsjahr 2020, die von den entsprechenden Ausschüssen gebilligt und zum 15. Februar 2021 genehmigt wurden. Darin enthalten sind alle durch die Lohn- und Gehaltsabrechnung zu verarbeitenden Zahlungen per März/April 2021, im Vorwege identifizierten Mitarbeitern zugeteilte NN Group-Anteile und NN IP Investmentansprüche (Fund-of-Fund mit einjähriger Haltedauer) sowie sämtliche bedingt zurückgestellten NN Group-Anteile und NN IP Investmentansprüche. Eine Angabe zu den zugeteilten Fonds steht nicht zur Verfügung.

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

**Gesamtbetrag der festen und variablen Vergütungen für das Leistungsjahr 2019**

| Für das Leistungsjahr 2019 zugeteilte feste und variable Vergütung | | | |
|---|---|---|---|
| **Geldbeträge in Tsd. Euro und brutto** | **Identifizierte Mitarbeiter, eingestuft als Geschäftsleitung (einschließlich Führungskräfte) (3)** | **Sonstige identifizierte Mitarbeiter (außer Mitglieder der Geschäftsleitung)** | **Sämtliche Mitarbeiter – ohne identifizierte Mitarbeiter** |
| **Anzahl der Mitarbeiter** | 8 | 12 | 640 |
| **Feste Vergütung (1)** | 2.997 | 3.089 | 61.437 |
| **Variable Vergütung (2)** | 1.294 | 1.540 | 15.032 |
| **Gesamtbetrag feste und variable Vergütung** | 4.291 | 4.629 | 76.469 |

Anmerkung 1): Feste Vergütung per Ultimo 2020 für vertragliche Arbeitsstunden. Die feste Vergütung umfasst tarifliche Pauschalzulagen, die Elemente wie Urlaubsgeld und Zulagen zur Altersvorsorge einschließen, aber Zuwendungen/Leistungen („Benefits“) ausschließen.

Anmerkung 2): Die variable Vergütung beinhaltet sämtliche bedingten und unbedingten Prämien in Bezug auf das Leistungsjahr 2020, die von den entsprechenden Ausschüssen gebilligt und zum 21. Februar 2020 genehmigt wurden. Darin enthalten sind alle durch die Lohn- und Gehaltsabrechnung zu verarbeitenden Zahlungen per März/April 2021, im Vorwege identifizierten Mitarbeitern zugeteilte NN Group-Anteile und NN IP Investmentansprüche (Fund-of-Fund mit einjähriger Haltedauer) sowie sämtliche bedingt zurückgestellten NN Group-Anteile und NN IP Investmentansprüche. Eine Angabe zu den zugeteilten Fonds steht nicht zur Verfügung.

Anmerkung 3): Die Kategorie Geschäftsleitung umfasst die Vergütung für alle sechs gesetzlich vorgesehenen NN IP Directors.

**Angaben zur Vergütung von Dritten**

NN Investment Partners B.V. (NN IP) hat seine Portfolioverwaltungstätigkeit (teilweise) an Dritte ausgelagert. Mit jedem Dritten wurde eine Portfolioverwaltungsvereinbarung (PMA) getroffen. Diese PMA garantiert effiziente und wirksame Dienstleistungen gemäß den festen Vereinbarungen mit diesen Dritten. Die von diesen Dritten angebotenen Dienstleistungen basieren auf der PMA und werden von NN IP jährlich bewertet.

Die Transparenz, die NN IP in Bezug auf die angewandte Vergütungspolitik walten lässt, erstreckt sich auch auf die Transparenz der Vergütungspolitik von Dritten, die Portfolioverwaltungstätigkeiten für NN IP durchführen. Dadurch orientiert sich NN IP an den Leitlinien der europäischen Aufsichtsbehörde (ESMA).

NN IP fordert Dritte jährlich auf, bestimmte Auskünfte zu erteilen, um die Dienstleistungen beurteilen zu können. Diese Auskunftsersuchen umfassen auch Angaben zu der von dem jeweiligen Dritten angewandten Vergütungspolitik. Weitere Angaben zur Vergütung dieser Dritten sind zu finden unter: https://nnip.com – About – Policies and governance – Remuneration policy - Remuneration information delegates.

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

**Methode zur Berechnung des Gesamtrisikos gemäß Bestimmungen des CSSF-Rundschreibens 11/512**

Einzelheiten zur VaR-Methode, zum Referenzportfolio beim relativen VaR-Ansatz, zur Nutzung der VaR-Limits (niedrigster VaR, höchster VaR, durchschnittlicher VaR), zum Modell und den für die Berechnung zugrunde gelegten Parametern sowie zur durchschnittlichen Hebelhöhe im Berichtsjahr zum 30. September 2021:

| **Teilfonds** | **NN (L) Alternative Beta** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | - |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 2,87% |
| Höchster VaR | 8,34% |
| Durchschnittlicher VaR | 4,85% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 150% |
| Nettoansatz | 125% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 114,35% |
| Nettoansatz | 13,21% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Asian Debt (Hard Currency)** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **J.P. Morgan Asia Credit (JACI)** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 93,27% |
| Höchster VaR | 224,46% |
| Durchschnittlicher VaR | 142,10% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 35% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 15,00% |
| Nettoansatz | 3,09% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Asian High Yield** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **ICE BofA Asian Dollar High Yield Corporate Constrained Index (20% lvl 4 sector 3% issuer cap)** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 108,47% |
| Höchster VaR | 166,42% |
| Durchschnittlicher VaR | 131,27% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 25% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 1,19% |
| Nettoansatz | 0,07% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Commodity Enhanced** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Commodity Total Return (BCOMTR)** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 42,57% |
| Höchster VaR | 118,99% |
| Durchschnittlicher VaR | 76,72% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 150% |
| Nettoansatz | 150% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 107,41% |
| Nettoansatz | 7,35% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Corporate Green Bond** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays MSCI Euro Green Bond: Unternehmensindex mit Emittentenobergrenze von 5%** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 96,10% |
| Höchster VaR | 105,37% |
| Durchschnittlicher VaR | 99,43% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 75% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 12,05% |
| Nettoansatz | 1,22% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Emerging Markets Corporate Debt** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **J.P. Morgan Corporate Emerging Market Bond (CEMBI) Diversified** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 87,85% |
| Höchster VaR | 265,53% |
| Durchschnittlicher VaR | 130,54% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 14,26% |
| Nettoansatz | 6,47% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Emerging Markets Debt (Hard Currency)** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **J.P. Morgan Emerging Market Bond (EMBI) Global Diversified** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 92,79% |
| Höchster VaR | 138,07% |
| Durchschnittlicher VaR | 120,10% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 113,28% |
| Nettoansatz | 3,05% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Emerging Markets Debt (Local Bond)** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **J.P. Morgan Government Bond-Emerging Market (GBI-EM) Global Diversified** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 100,24% |
| Höchster VaR | 107,70% |
| Durchschnittlicher VaR | 102,66% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 400% |
| Nettoansatz | 175% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 25,52% |
| Nettoansatz | 10,63% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Emerging Markets Debt (Local Currency)** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | - |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 1,95% |
| Höchster VaR | 6,49% |
| Durchschnittlicher VaR | 3,58% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 500% |
| Nettoansatz | 250% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 101,94% |
| Nettoansatz | 58,26% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Emerging Markets Debt Short Duration (Hard Currency)** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | - |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 0,43% |
| Höchster VaR | 1,81% |
| Durchschnittlicher VaR | 0,96% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 100% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 9,80% |
| Nettoansatz | 0,00% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Euro Covered Bond** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Securitized Covered** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 91,73% |
| Höchster VaR | 109,48% |
| Durchschnittlicher VaR | 100,49% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 100% |
| Nettoansatz | 25% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 6,69% |
| Nettoansatz | 3,13% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Euro Credit** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Corporate** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 83,49% |
| Höchster VaR | 111,58% |
| Durchschnittlicher VaR | 100,12% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 100% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 23,70% |
| Nettoansatz | 9,73% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Euro Fixed Income** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays Euro Aggregate** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 57,45% |
| Höchster VaR | 115,41% |
| Durchschnittlicher VaR | 80,99% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 250% |
| Nettoansatz | 150% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 113,28% |
| Nettoansatz | 50,78% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Euro Income** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **MSCI EMU** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 64,30% |
| Höchster VaR | 124,10% |
| Durchschnittlicher VaR | 97,19% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 150% |
| Nettoansatz | 35% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 26,33% |
| Nettoansatz | 1,40% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Euro Long Duration Bond** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays Euro Aggregate 10+Y** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 89,66% |
| Höchster VaR | 111,13% |
| Durchschnittlicher VaR | 95,80% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 150% |
| Nettoansatz | 75% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 68,38% |
| Nettoansatz | 20,83% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Euro Sustainable Credit** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays Euro Aggregate Corporate** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 90,11% |
| Höchster VaR | 109,64% |
| Durchschnittlicher VaR | 101,14% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 100% |
| Nettoansatz | 25% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 20,04% |
| Nettoansatz | 7,89% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| Teilfonds | NN (L) Euro Sustainable Credit (excluding Financials) |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Corporate ex Financials In** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 91,44% |
| Höchster VaR | 108,89% |
| Durchschnittlicher VaR | 99,44% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 100% |
| Nettoansatz | 25% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 21,30% |
| Nettoansatz | 9,51% |

| Teilfonds | NN (L) Euromix Bond |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays Euro-Aggregate Treasury AAA 1-10Y** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 57,19% |
| Höchster VaR | 107,85% |
| Durchschnittlicher VaR | 73,86% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 50% |
| Nettoansatz | 25% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 14,36% |
| Nettoansatz | 1,63% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) European High Yield** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **ICE BofAML European Currency High Yield Constrained ex Subordinated Financials** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 94,92% |
| Höchster VaR | 140,06% |
| Durchschnittlicher VaR | 116,27% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 25% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 23,30% |
| Nettoansatz | 7,27% |

| **Teilfonds** | **NN (L) First Class Multi Asset** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | **-** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 0,87% |
| Höchster VaR | 5,48% |
| Durchschnittlicher VaR | 2,57% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 300% |
| Nettoansatz | 35% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 123,96% |
| Nettoansatz | 14,05% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) First Class Multi Asset Premium** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | - |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 1,51% |
| Höchster VaR | 7,38% |
| Durchschnittlicher VaR | 3,43% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 650% |
| Nettoansatz | 400% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 160,42% |
| Nettoansatz | 22,17% |

| **Teilfonds** | **NN (L) First Class Stable Yield Opportunities** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | - |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 0,40% |
| Höchster VaR | 1,82% |
| Durchschnittlicher VaR | 0,77% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 400% |
| Nettoansatz | 100% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 122,02% |
| Nettoansatz | 30,01% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) First Class Yield Opportunities** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | **-** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 0,75% |
| Höchster VaR | 4,03% |
| Durchschnittlicher VaR | 1,66% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 400% |
| Nettoansatz | 100% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 151,50% |
| Nettoansatz | 21,80% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Frontier Markets Debt (Hard Currency)** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **J.P. Morgan Next Generation Markets (NEXGEM) ex Argentina** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 108,50% |
| Höchster VaR | 131,36% |
| Durchschnittlicher VaR | 120,41% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 26,14% |
| Nettoansatz | 1,22% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Global Bond Opportunities** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | - |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 1,52% |
| Höchster VaR | 4,54% |
| Durchschnittlicher VaR | 2,93% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 1400% |
| Nettoansatz | 900% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 625,53% |
| Nettoansatz | 300,58% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Global High Yield** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays High Yield 70% US 30% Pan-European ex Fin Subord 2% Issuer Capped** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 95,37% |
| Höchster VaR | 118,43% |
| Durchschnittlicher VaR | 102,99% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 25% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 15,12% |
| Nettoansatz | 7,19% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Global Inflation Linked Bond** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays World Govt Inflation-Linked All Maturities EUR (hedged)** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 91,28% |
| Höchster VaR | 104,20% |
| Durchschnittlicher VaR | 97,87% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 500% |
| Nettoansatz | 300% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 101,21% |
| Nettoansatz | 21,75% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Global Investment Grade Credit** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays Global Aggregate Corporate** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 86,04% |
| Höchster VaR | 116,88% |
| Durchschnittlicher VaR | 102,50% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 77,59% |
| Nettoansatz | 32,10% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Green Bond** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays MSCI Euro Green Bond (NR)** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 94,88% |
| Höchster VaR | 104,23% |
| Durchschnittlicher VaR | 100,71% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 75% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 17,53% |
| Nettoansatz | 4,73% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Green Bond Short Duration** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | **-** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 0,29% |
| Höchster VaR | 1,20% |
| Durchschnittlicher VaR | 0,55% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 175% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 58,42% |
| Nettoansatz | 1,25% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Multi Asset Factor Opportunities** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | - |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 2,17% |
| Höchster VaR | 9,07% |
| Durchschnittlicher VaR | 4,89% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 1300% |
| Nettoansatz | 1150% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 1020,19% |
| Nettoansatz | 406,03% |

| **Teilfonds** | **NN (L) Multi Asset High Income** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Absoluter VaR** |
| **Referenzportfolio** | - |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 20% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 1,80% |
| Höchster VaR | 8,04% |
| Durchschnittlicher VaR | 3,34% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 100% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 120,70% |
| Nettoansatz | 8,79% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) Sovereign Green Bond** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays MSCI Euro Green Bond Treasury and Government-Related Index** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 99,92% |
| Höchster VaR | 102,02% |
| Durchschnittlicher VaR | 101,03% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 75% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | -75,86% |
| Nettoansatz | 8,66% |

| **Teilfonds** | **NN (L) US Credit** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays US Aggregate Corporate** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 94,83% |
| Höchster VaR | 111,09% |
| Durchschnittlicher VaR | 100,94% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 50% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | -1253,19% |
| Nettoansatz | 7,11% |

# Sonstige Informationen für die Anteilsinhaber (ungeprüft)(Fortsetzung)

| **Teilfonds** | **NN (L) US Factor Credit** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **Bloomberg Barclays US Aggregate Corporate** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 87,83% |
| Höchster VaR | 107,29% |
| Durchschnittlicher VaR | 98,38% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 150% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 60,99% |
| Nettoansatz | 58,45% |

| **Teilfonds** | **NN (L) US High Yield** |
|---|---|
| **Gesamtrisiko - Methode** | **Relativer VaR** |
| **Referenzportfolio** | **ICE BofAML US High Yield Constrained TR** |
| **Value-at-Risk-Ansatz** | |
| Verordnungsrechtliche Grenze | 200% |
| Verwendetes VaR-Modell | parametrisch |
| Niedrigster VaR | 91,86% |
| Höchster VaR | 128,52% |
| Durchschnittlicher VaR | 108,12% |
| Umfang der Datenhistorie | 1 Jahr |
| Häufigkeit Kursrendite | 1 Tag |
| Decay-Faktor | 0,94 |
| Zeithorizont | 1 Monat |
| Konfidenzintervall | 99% |
| **Hebel** | |
| **Erwartete Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 200% |
| Nettoansatz | 25% |
| **Durchschnittlich gemessene Hebelhöhe** | |
| Bruttoansatz | 14,00% |
| Nettoansatz | 0,98% |

Weitere Informationen sind erhältlich bei:

NN Investment Partners B.V.
P.O. Box 90470
Schenkkade 65
2509 LL The Hague
The Netherlands
E-mail: **info@nnip.com**
oder **www.nnip.com**